

# 海富通精选贰号混合型证券投资基金更新招募说明书

(2011年第1号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金根据2007年3月13日中国证券监督管理委员会《关于同意海富通精选贰号证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2007】63号)和2007年3月21日《关于海富通精选贰号混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2007】70号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2007年4月9日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险,本基金投资债券引发的信用风险,等等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人

作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者投资于本基金前应认真阅读本《招募说明书》。

本基金和本基金管理人目前管理的海富通精选证券投资基金在投资管理上有着相同或相似的投资目标、投资理念、投资范围和投资策略，但本基金与海富通精选证券投资基金是两只相互独立的基金，在投资运作上完全独立，在投资组合上可能不同，从而造成两只基金业绩的差异。请投资者注意区分对待，谨慎投资。

本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 4 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 3 月 31 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 海富通精选贰号混合型证券投资基金更新招募说明书

## 目 录

一、	绪言.....	2
二、	释义.....	2
三、	基金管理人.....	6
四、	基金托管人.....	14
五、	相关服务机构.....	18
六、	基金的募集.....	34
七、	基金合同的生效.....	36
八、	基金份额的申购与赎回.....	37
九、	基金的转换.....	43
十、	基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	47
十一、	基金的投资.....	47
十二、	基金的业绩.....	57
十三、	基金的财产.....	58
十四、	基金资产的估值.....	59
十五、	基金的收益与分配.....	62
十六、	基金的费用与税收.....	64
十七、	基金的会计与审计.....	65
十八、	基金的信息披露.....	66
十九、	基金的风险揭示.....	70
二十、	基金的终止与清算.....	72
二十一、	基金合同的内容摘要.....	73
二十二、	基金托管协议的内容摘要.....	85
二十三、	对基金份额持有人的服务.....	95
二十四、	基金注册登记人.....	96
二十五、	基金管理人和基金托管人的更换.....	98
二十六、	招募说明书的存放及查阅方式.....	100
二十七、	备查文件.....	100

## 一、 绪言

本招募说明书依据《基金法》及其配套法规、本基金的基金合同以及其他法律法规编写。

本招募说明书阐述了海富通精选贰号混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金根据本招募说明书所载明的资料管理运作并交易。本招募说明书由海富通基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据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：指海富通精选贰号混合型证券投资基金；
- 基金合同或本基金合同：指《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：指《海富通精选贰号混合型证券投资基金证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
- 发售公告：指《海富通精选贰号混合型证券投资基金证券投资基金基金份额发售公告》
- 托管协议：指《海富通精选贰号混合型证券投资基金证券投资基金托管

- 协议》及其任何有效修订和补充；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
- 《证券法》：指《中华人民共和国证券法》；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
- 《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
- 元：指人民币元；
- 基金管理人：指海富通基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。对于投资人通过销售机构提交的基金交易业务申请（包括基金认购、申购、赎回、转换、转托管、分红方式设置等），其最终处理结果以注册登记机构的确认为准；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相

- 者： 关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人大会： 指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 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3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、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
- 存续期： 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 工作日： 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 认购： 指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购： 指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回： 指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；
- 基金转换： 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
- 转托管： 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
- 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；
- 会员单位： 指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员；

- 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构；
- 销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；
- 场内：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所；
- 场外：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统外办理开放式基金份额认购、申购、赎回等业务的销售机构和场所；
- 基金销售网点：指基金管理人的直销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：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户；
- 开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T 日：指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
- 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
- 基金资产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
- 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值：指基金资产净值除以基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
- 基金资产估值：指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；

- 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

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

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

法定代表人：邵国有

设立时间：2003 年 4 月 1 日经中国证监会批准设立

注册资本：1.5 亿元

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

电话：021-38650999

联系人：包瑾

#### （二）主要人员情况

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

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

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

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

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

董文标先生,独立董事,硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长,中国民生银行党委委员、副行长,中国民生银行党委书记、行长,现任中国民生银行董事长、党委书记。

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

巴约特(Marc Bayot)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授,EFAMA(欧洲基金和资产管理协会)和比利时基金公会名誉主席,INVESTPROTECT 公司(布鲁塞尔)董事总经理、Pionner 投资公司(米兰,都柏林,卢森堡)和 Degroof 资产管理(布鲁塞尔)独立董事、基金联合公会(哥本哈根)独立董事。

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

李础前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师。历任安徽省社联所属省新

科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行香港分行行政总裁。

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

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

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

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

丁俊先生，硕士。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司，曾任权益投资部研究主管，2006年4月加入海富通基金管理有限公司，任海富通精选混合基金和海富通风格优势股票基金基金经理助理，2007年8月起任海富通精选混合基金和海富通精选贰号混合基金基金经理。

本基金历任基金经理为陈洪，任职时间为2007年4月至2007年8月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会

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

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、 办理基金备案手续；
- 3、 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、 召集基金份额持有人大会；
- 10、 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、 中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

- 1、 基金管理人承诺将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。
- 2、 基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。
- 3、 基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - 1) 基金之间相互投资；

- 2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
  - 3) 从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务;
  - 4) 动用银行信贷资金从事基金投资;
  - 5) 将基金资产用于非法抵押、担保、资金拆借或者贷款;
  - 6) 从事证券信用交易;
  - 7) 以基金资产进行房地产投资;
  - 8) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
  - 9) 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) 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) 进行内幕交易、操纵市场;
  - 12) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:
- 1) 越权或违规经营;
  - 2) 违反基金合同或托管协议;
  - 3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
  - 4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
  - 5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
  - 6) 玩忽职守、滥用职权;
  - 7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
  - 8) 除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;
  - 9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

- 10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
  - 11) 贬损同行，以提高自己；
  - 12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
  - 13) 以不正当手段谋求业务发展；
  - 14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
  - 15) 法律法规禁止的其他行为。
- 5、 基金经理承诺：
- 1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
  - 2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
  - 3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
  - 4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## （五）基金管理人的内部控制制度

### 1、 风险管理和内部控制的原则

风险管理和内部控制是指通过风险识别和风险评价，并在此基础上优化组合各种风险管理技术以及组织制度和管理框架，有效控制风险和妥善处理风险所致损失的后果，以获得最大的安全保障。风险管理和内部控制遵循以下原则：

- 1) 全面性原则：风险管理和内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；
- 2) 独立性原则：公司根据管理业务的需要设立保持相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，协助和配合督察长负责对公司各部门内部风险管理工作进行稽核和检查；
- 3) 审慎性原则：内部管理的核心是有效防范各种风险，任何制度的

建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

- 4) 有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行风险管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；
- 5) 及时性原则：内部管理制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；
- 6) 适时性原则：内部管理制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；
- 7) 定量与定性相结合的原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险管理和内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，实现对公司决策层到管理层和操作层的全面监督和控制，具体包括以下部分：

- 1) 董事会对风险管理和内部控制负最高责任。董事会认为必要时，可聘请公司外专业人士，组成专家顾问委员会，提供有关风险管理和内部控制的专业意见。
- 2) 董事会下设风险委员会，负责制定公司投资管理风险、运营风险、道德风险和其他风险的衡量标准，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策。风险委员会责成管理层制定相应的监测系统、防范措施、补救措施以及定期的风险控制报告。
- 3) 管理层设风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策，具体负责对各类风险的识别、拟定防范和控制的措施、收集分析各类数据进行监测反馈、实施各种必要的应急补救措施，并就风险的整体控制管理定期地向董事会风险委员会作出报告。
- 4) 业务部门依据风险管理委员会提出的方针和政策，结合本部门的业务特点具体制定部门作业流程和风险管理制度，并负责日常的风险管理，通过部门作业流程及风险管理制度的制定与执行，将风险控制在最小范围内。

- 5) 督察长和监察稽核部负责协助业务部门制定作业流程和制度, 评价、监督、检查各部门内部控制制度的制定与执行情况, 督察长负责对风险管理委员会的风险管理决策和公司各项风险管理制度的执行情况进行检查, 向董事会风险委员会、董事会提交报告。督察长和监察稽核部还应根据外部环境和公司新业务的开展提出风险管理的建议。

### 3、 风险管理和内部控制的制度

#### 1) 投资风险管理制度

基金投资风险管理的主要内容是对市场风险和流动性风险的管理。对市场风险的管理包括: 建立完备的系统性风险预警和监控系统, 对于一般系统性风险, 由投资部在投资决策委员会制定的风险管理原则下按照谨慎原则积极防范, 对于重大系统性风险, 经公司风险管理委员会同意并授权后, 对基金的投资策略作重大调整, 同时做好与基金份额持有人、托管人和监管部门的沟通工作。对流动性风险的管理包括: 建立评判和监测基金资产流动性的量化指标, 建立使基金现金流出与资产流动性相匹配的系统, 定期检查和分析基金投资组合的流动性。公司在尽可能的范围内运用数量化模型和计算机软件系统辅助管理基金资产的市场风险和流动性风险。

#### 2) 道德风险管理制度

道德风险分基金管理公司和公司员工两个层次。对公司道德风险的管理包括: 设立独立董事, 加强对公司高级管理人员任免、公司和基金审计事务等的监督; 充分发挥监事会的监督职能; 健全并严格执行公司有关关联交易的各项限制性措施和控制性程序。对员工道德风险的管理包括: 教育员工熟悉和遵守员工守则; 对照各部门的员工守则, 定期、不定期检查员工具体执行情况; 将员工守法情况和职业道德作为录用和提升的重要标准; 对于基金经理, 还实施承诺与质询制度、投资限制制度、谈话提醒制度和强制休假制度等。

#### 3) 操作风险管理制度

操作风险管理是指通过完善内部控制制度和合规检查制度、严格落实执行和定期安全检查, 防范公司业务操作中因人为因素或管理系统设置不当造成操作失误所引致的风险。操作风险管理制度由一系列具体制度构成, 包括: 投资管理制度、集中交易制度、基础设施故障风险管理制度、信息披露制度、信息资料保全

制度、保密制度、财务会计制度、电子信息系统控制制度、岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度和宣传制度等。

#### 4) 合规性风险管理制度

合规性风险管理制度通过对公司所有业务步骤中可能涉及基金份额持有人利益的部分作出明确规定，以最大限度地保护基金份额持有人的合法权益，保证基金管理业务合规审慎进行。

#### 5) 稽核监察制度

公司实行独立的稽核监察制度，督察长和监察稽核部有权对公司所有工作部门、工作环节及员工遵守法律法规和公司规章的情况进行稽核监察，并提出改进建议。公司保证稽核监察工作的独立性和客观性。

### 4、基金管理人关于风险管理和内部控制的声明

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

## 四、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务

理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

### （三）证券投资基金托管情况

截止 2011 年 3 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、

招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)等107只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### (四) 托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

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

## **五、 相关服务机构**

### **（一）基金份额发售机构**

#### **1、直销机构：海富通基金管理有限公司**

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

法定代表人：邵国有

电话：021 - 38650797

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

公司网址：www.hftfund.com

#### **2、代销机构**

##### **（1） 中国银行股份有限公司**

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

##### **（2） 中国建设银行股份有限公司**

地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(3) 中国工商银行股份有限公司

地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

联系人：刘业伟

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

(4) 交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

电话：021-58781234

联系人：曹榕

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

(5) 招商银行股份有限公司

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客户服务电话：95555

联系人：邓炯鹏

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

(6) 深圳发展银行股份有限公司

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

客户服务电话：95501

联系人：姜聃

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

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

电话：021-61616152，61616153

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

(8) 兴业银行股份有限公司

地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

联系人：梁曦

网址：www.cib.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

地址：北京市东城区正义路 4 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

客户服务电话：95508

联系人：詹全鑫 张大奕

网址：www.gdb.com.cn

(11) 中信银行股份有限公司

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

客户服务电话：95558

联系人：王巍、李博

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

**(12) 浙商银行股份有限公司**

地址: 中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人: 张达洋

客户服务电话: 95527

联系人: 毛真海

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

**(13) 宁波银行股份有限公司**

地址: 宁波市江东区中山东路294号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 96528

联系人: 胡技勋

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

**(14) 华夏银行股份有限公司**

地址: 北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人: 吴建

客户服务电话: 95577

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

**(15) 海通证券股份有限公司**

地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

客户服务电话: 021-95553 或 4008888001

联系人: 李笑鸣

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

**(16) 东北证券股份有限公司**

地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

客户服务电话: 0431-96688

联系人: 潘锴

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(17) 国泰君安证券股份有限公司

地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人: 祝幼一

客户服务电话: 021-962588、400-8888-666

联系人: 韩星宇

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

(18) 申银万国证券股份有限公司

地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

客户服务电话: 962505

联系人: 邓寒冰

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

(19) 中信建投证券有限责任公司

地址: 北京朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人: 张佑君

客户服务电话: 400-8888-108

联系人: 权唐

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(20) 招商证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人: 官少林

客户服务电话: 400-8888-111 或 95565

联系人: 林生迎

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

(21) 兴业证券股份有限公司

地址: 福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人: 兰荣

客户服务电话: 400-8888-123

联系人: 谢高得

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

(22) 长江证券股份有限公司

地址: 武汉市新华下路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

电话: 95579 或 4008-888-999

联系人: 李良

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

(23) 华泰联合证券有限责任公司

地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人: 马昭明

客户服务电话: 400-8888-555、95513

联系人: 盛宗凌

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

(24) 东方证券股份有限公司

地址: 上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人: 潘鑫军

客户服务电话: 95503

联系人: 吴宇

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

(25) 国信证券股份有限公司

地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层到 26 层

法定代表人: 何如

客户服务电话: 95536

联系人: 齐晓燕

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

(26) 中国银河证券股份有限公司

地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 顾伟国

客户服务电话: 4008-888-888

联系人：田薇

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

(27) 平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：4008816168

联系人：郑舒丽

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

(28) 财通证券有限责任公司

地址：杭州市解放路 111 号财通证券

法定代表人：沈继宁

客户服务电话：0571-96336（上海地区 962336）

联系人：乔俊

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

(29) 中信万通证券有限责任公司

地址：青岛市市南区东海路 28 号

法定代表人：张智河

客户服务电话：电话：0532-96577

联系人：吴忠超

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

(30) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

客户服务电话：400-887-8827

联系人：莫晓丽

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

(31) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95597

联系人：万鸣

网址：www.htsc.com.cn

(32) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：400-8888-788

联系人：刘晨、李芳芳

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

(33) 中信证券股份有限公司

地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

(34) 中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

客户服务电话：400-6208-888

联系人：张静

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

(35) 世纪证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

联系人：张婷

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

(36) 中信金通证券有限责任公司

地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人：刘军

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

网址：www.bigsun.com.cn

**(37) 国海证券有限责任公司**

地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅峰

客户服务电话：96100（广西），4008888100（全国）

联系人：武斌

网址：www.ghzq.com.cn

**(38) 恒泰证券股份有限公司**

地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号

法定代表人：刘汝军

电话：021-4961259

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

**(39) 瑞银证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡

网址：www.ubssecurities.com

**(40) 中航证券有限责任公司**

地址：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

电话：4008866567

联系人：余雅娜

网址：www.scstock.com

**(41) 国元证券股份有限公司**

地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

客户服务电话：0551-96888

联系人：陈琳琳

网址：www.gyzq.com.cn

**(42) 德邦证券有限责任公司**

住所：上海市福山路 500 号城建大厦 26 层

法定代表人：方加春

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

**(43) 宏源证券股份有限公司**

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：汤世生

客户服务电话：4008-000-562

联系人：李巍

网址：www.hysec.com

**(44) 齐鲁证券有限公司**

地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

网址：www.qlzq.com.cn

**(45) 第一创业证券有限责任公司**

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系人：魏颖

网址：www.firstcapital.com.cn

**(46) 湘财证券有限责任公司**

地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：陈学荣

客户服务电话：400-888-1551

联系人：鲁雁先

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

**(47) 安信证券股份有限公司**

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

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

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

**(48) 中国建银投资证券有限责任公司**

地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

客户服务电话：400-600-8008

联系人：刘权

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

**(49) 中国国际金融有限公司**

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：李剑阁

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：易建军

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

**(50) 中国民族证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层-9 层

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

联系人：李微

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

**(51) 华宝证券有限责任公司**

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

联系人：刘闻川

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

**(52) 信达证券股份有限公司**

地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

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

**(53) 长城证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：400666888

联系人：匡婷

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

**(54) 方正证券有限责任公司**

地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95571

联系人：彭博

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

**(55) 广发华福证券有限责任公司**

地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：96326

联系人：张腾

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

**(56)** 东莞证券有限责任公司

地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：游锦辉

客户服务电话：961130

联系人：梁建伟

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

**(57)** 渤海证券股份有限公司

地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

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

**(58)** 广州证券有限责任公司

地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼

法定代表人：吴志明

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

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

**(59)** 华龙证券有限责任公司

地址：甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

客服电话：0931 4890208

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

**(60)** 江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：郭玲

客服电话：400-666-2288

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

**(61) 财富证券有限责任公司**

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

联系人：朱友谊

客服电话：0731-4403360

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

**(62) 山西证券股份有限公司**

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

客服电话：400-666-1618

公司网站：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

**(63) 民生证券有限责任公司**

地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 层

法定代表人：岳献春

联系人：赵明

客服电话：4006198888

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

**(64) 东兴证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：崔海涛

客户服务电话：4008-888-993

联系人：黄英

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

**(65) 大通证券股份有限公司**

地址：大连市沙河口区会展路 129 号

法定代表人：于宏民

联系人：谢立军

客服电话：40089 18918, 021-962518

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

(66) 上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：4008 169 169

联系人：陈翔

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(67) 国都证券有限责任公司

地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

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

(68) 红塔证券股份有限公司

地址：云南省昆明市北京路 155 号附一号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

客户服务电话：0871 - 3577888

联系人：刘晓明

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

(69) 日信证券有限责任公司

地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

客户服务电话：010-88086830

联系人：陈韦杉

网址：<http://www.rxzq.com.cn>

(70) 英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：赵文安

客户服务电话：0755-26982993

联系人：王睿

网址：<http://www.ydsc.com.cn>

(71) 中山证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

客户服务电话：0755-82943750

联系人：李珍

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

(72) 江南证券有限责任公司

地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：姚江涛

电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

## (二) 注册登记人

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

## (三) 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：0755-22163333

经办律师：靳庆军、宋萍萍

#### **(四) 会计师事务所**

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、金毅

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金毅

## **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》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字【2007】第 63 号文批准募集。

### **(二) 基金存续期间：不定期**

### **(三) 基金运作方式：契约型开放式**

### **(四) 基金类型：混合型**

### **(五) 募集方式：募集期内本基金管理人代销网点和直销中心将同时面向个人投资者和机构投资者发售本基金。**

投资者仅可通过场外销售渠道认购本基金：场外销售渠道是指通过上海证券交易所开放式基金销售系统之外的办理相关业务的本基金管理人的直销中心和代销机构（具体名单见基金份额发售公告）。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

### **(六) 募集期限：自基金份额发售之日起不超过 3 个月，本基金的实际募集期**

限为 2007 年 3 月 26 日至 2007 年 4 月 3 日。

(七) **募集对象:** 中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）以及境外合格机构投资者。

(八) **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。

(九) **募集目标**

本基金的首发募集规模拟不超过 100 亿份。本基金募集实行“先到先得”的销售机制；超过设定募集规模的，将作为认购申请失败处理。基金管理人设置了 80 亿元的警戒线，当第 N 日累计募集规模达到 80 亿的警戒线时，基金管理人将于当日上报监管部门，当晚即在基金管理人网站及代销机构网站发布提前结束募集公告，并在第 N+1 日通过指定披露媒体刊登提前结束募集公告，无论是否达到募集目标，N+1 日当天都为最后一个认购日。在 N+1 日累计募集规模超过目标上限的情况下，则按当日“先到先得”的销售机制，超过设定募集规模的，将作为认购申请失败处理。

极端情况下，如果出现正式发售当天就接近或达到发行上限时，基金管理人将上报监管部门，及时在管理人网站及代销机构网站公告停止销售，并于次日通过指定信息披露报刊刊登公告，宣布本基金提前结束发售并立即生效、自公告发布的当日起不再接受认购。

基金合同生效后，基金规模不受上述募集规模上限的限制。具体详情请参见发售相关公告。

(十) **认购费率**

认购本基金采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。前端认购费率按认购金额分档如下：

认购金额（含申购费）	前端认购费率
$M \geq 1000$ 万	按笔收取，1000 元/笔
$500$ 万 $\leq M < 1000$ 万	1.0%
$100$ 万 $\leq M < 500$ 万	1.6%
$M < 100$ 万	2.0%

投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

(十一) **认购份额的计算**

本基金采用金额认购方法，基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。前端认购时计算方法如下：

$$\text{认购费} = \text{认购金额} \times \text{认购费率} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} - \text{认购费} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

基金份额以四舍五入的方法保留到小数点后两位。

## (十二) 投资人对基金份额的认购

1、认购的时间安排、投资人认购应提交的文件和办理手续、认购的方式详见本基金基金份额发售公告。

2、基金认购期结束后，若基金合同生效，海富通基金管理有限公司注册登记中心在认购期结束后 30 日内为投资者寄送认购确认单，投资者也可以通过海富通基金管理有限公司直销柜台、客户服务中心或网上交易系统查询最终认购确认情况。

3、认购的限额：投资者在募集期内可以多次认购基金份额，已经受理的认购申请不得撤销，本基金单次认购的最低金额为 1000 元。

## (十三) 募集资金利息的处理方式

本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期产生的利息在本基金合同生效后折算成基金份额，归基金份额持有人所有。利息折算的基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

# 七、 基金合同的生效

## (一) 基金合同生效的条件

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

- 1、在募集期限内基金募集份额总额不少于两亿份，基金募集金额不少于两亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于两百人；

基金备案获中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。

## (二) 基金募集失败

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银

行同期存款利息。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

（四）本基金的基金合同已于2007年4月9日正式生效。

## 八、 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的办理场所

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。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。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、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资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、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金已于 2007 年 5 月 21 日起开始办理包括日常申购、赎回在内的日常交易业务。

### （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、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金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，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

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前3日予以公告。

### （四） 申购与赎回的程序

#### 1、 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

#### 2、 申购与赎回申请的确认

基金管理人应在法律法规规定的时限内对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。

#### 3、 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本

基金合同和有关法律法规规定处理。

### （五） 申购与赎回的数额限制

#### 1、 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1） 投资人每次最低申购金额为 1000 元。

（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 1000 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 1000 份的，需一次全部赎回。

（3） 基金份额持有人在单个销售机构处持有本基金的最低份额为 1000 份。基金份额持有人因赎回后导致其基金账户内在该销售机构处剩余的基金份额低于 1000 时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

2、 基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前 3 日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

### （六） 申购和赎回的数额和价格

#### 1、 申购份额的计算

申购本基金采用前端收费模式，即在申购基金时缴纳申购费。

申购费 = 申购金额 × 申购费率 / (1 + 申购费率)

申购份额 = (申购金额 - 申购费) / T 日基金份额净值

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

#### 2、 赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回金额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

### (七) 申购与赎回的费用

- 1、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
- 2、根据基金合同的规定，本基金申购费率不超过 2.0%，赎回费率不超过 0.5%。
- 3、申购费率按照申购金额逐级递减，投资人在一天之内如果有多笔申购的，按单笔申购金额确定每笔申购所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
M ≥ 1000 万	按笔收取，1000 元/笔
500 万 ≤ M < 1000 万	1.0%
100 万 ≤ M < 500 万	1.6%
M < 100 万	2.0%

- 4、本基金赎回费率按持有期分档如下：

持有期	赎回费率
1 年以下	0.5%
1 年（含）以上，2 年以下	0.25%
2 年（含）以上	0%

注：赎回费总额的 25% 归入基金资产

- 5、在遵守法律法规及基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对特定时间范围、特定地域范围、特定行业、特定职业等的投资者或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者等定期或不定期地开展。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投资者调低基金申购费率、赎回费率。

### **(八) 申购与赎回的注册登记**

- 1、 经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。
- 2、 投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。
- 3、 投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。
- 4、 基金管理人可在法律法规允许的范围内及技术条件允许的情况下，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 日在至少一种指定媒体予以公告。

### **(九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理**

- 1、 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：
  - 1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
  - 2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
  - 3) 基金资产规模过大，基金管理人无法找到合适的投资品种，或继续接受申购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；
  - 4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
  - 5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

- 2、 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：
  - 1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
  - 2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
  - 3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

- 4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况;
- 5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

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

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

- 3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。
- 4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应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一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## (十) 巨额赎回的认定及处理

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

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

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续两 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；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体公告。

## 九、 基金的转换

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

### (一) 基金转换

基金转换是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金（包括本基金）的基金份额转为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金（包括本基金）的基金份额的行为。

## （二）基金转换申请人的范围

本基金的任何基金份额持有人均可以按照《基金合同》的规定申请和办理基金转换。

## （三）基金转换受理场所

基金转换将通过基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点进行。

## （四）基金转换受理时间

基金管理人自 2007 年 5 月 21 日开始推出基金的转换业务。

办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

## （五）基金转换费用

1、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

（1）基金转换申购补差费：当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

（2）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用，转出基金赎回费归转出基金资产的比例，参见转出基金招募说明书的规定。

（3）计算基金转换的申购补差费按照转出和转入基金的正常申购费率执行。

2、特别提示：由海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票、海富通强化回报混合、海富通风格优势股票、海富通稳健添利债券 A、海富通领先成长股票、海富通中小盘股票转换到本基金时，如果投资者的转入金额在 500 万（含）到 1000 万之间，在收取基金转换的申购补差费时，直接以本基金该档次申购费率（即 1.0%）计算申购补差费，将不再扣减申购原基金时已缴纳的 1000 元申购费。

基金管理人可自行决定调低转换费率，并最迟于新费率开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

## （六）基金转换公式

1、前端收费模式下，基金的转换公式为：

$$A=[B \times C \times (1-D) / (1+H) +G] / E$$

$$F=B \times C \times D$$

$$J=[B \times C \times (1-D) / (1+H)] \times H$$

其中，

A 为转入的基金份额数量；

B 为转出的基金份额数量；

C 为转换当日转出基金份额净值；

D 为转出基金份额的赎回费率；

E 为转换当日转入基金份额净值；

F 为转出基金份额的赎回费；

G 为转出基金份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币市场基金的，则  $G = 0$ ；

H 为申购补差费率，当转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率时，则  $H=0$ ；

J 为申购补差费。

转出金额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转出基金的基金资产中列支；转入份额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转入基金的基金资产中列支。

2、基金管理人在不损害各基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

### （七）基金转换的程序

#### 1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

#### 2、基金转换申请的确认

基金管理人应以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

### （八）基金转换的数额限制

基金转换按照份额进行，申请转换份额精确到小数点后两位，单笔转换份额

不得低于 1000 份。

### （九）基金转换的注册登记

1、基金投资者提出的基金转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

2、基金份额持有人申请基金转换成功后，基金注册登记机关在 T+1 工作日为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 日予以公告。

### （十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受各基金份额持有人的基金转换申请：

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 基金管理人认为可能有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换申请；
- 4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、发生《基金合同》或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 1 日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 3 日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

## 十、 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

(一) 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”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社会团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

(二) 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

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

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

(五) 根据相关法律法规的规定，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 十一、 基金的投资

### (一) 投资目标

本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略,实施全程风险管理,在保证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。

## （二）投资理念

发掘市场价格和价值之间的差异,将中国经济长期增长的潜力最大限度地转化为基金资产的长期增值。本基金认为,中国资本市场处于高速发展的早期阶段,市场成熟度和有效性较低,企业内在价值和市场价格之间存在较大差距有待发掘。本基金将依托国际专业研究支持平台与本土研究团队的智慧,深入把握世界经济和行业周期及国内经济、行业背景与变革、企业微观运行等因素,通过走访企业,取得第一手资料,识别风险,精选证券。

## （三）投资方向

本基金为混合型基金。投资方向限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资 50%-80%,债券投资 20%-50%,权证投资 0-3%;本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金股票投资的主要对象分为两类:第一类是经过严格筛选、符合本基金选股标准的优质且价格合理的上市公司,这部分上市公司是本基金的重点投资对象;第二类是公司现状不理想但基本面将发生实质性变化,并且这些都尚未充分反映在股价中的上市公司。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在征得有关监管机构许可后,可以将其纳入投资范围,不需召开基金份额持有人大会。

## （四）投资策略

本基金的投资策略分两个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。

### 1. 资产配置策略

本基金采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统,结合定量分析和定性分析,形成对不同市场的预测和判断,适度主动地动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的比例,以规避或控制市场系统性风险,提高基金收益率。

## 2. 精选证券策略

### (1) 精选股票策略

本基金管理人基于对国际市场投资管理经验的认识和对中国证券市场的实证分析，建立了精选股票分析决策支持系统，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，从定价指标（“向后看”）和盈利预测指标（“向前看”）两个方面，以基本面分析为主要手段，重视取得第一手资料，识别和控制风险，积极主动精选个股。

### (2) 精选债券策略

本基金的债券投资对象包括国债、金融债、企业债（包括可转换债）和债券回购等。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。

## 3. 权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的；在个股层面上，充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

## (五) 投资管理程序

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

1. 投资部策略分析师、股票分析师、定息产品分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据；

2. 投资策略月会决定基金的资产配置比例和股票、债券的投资重点等；
3. 投资每周例会根据投资策略月会的决定，结合市场和公司基本面的变化，决定具体的投资策略；
4. 基金经理依据策略分析师的宏观经济分析和策略建议、股票分析师的行业分析和个股研究、定息产品分析师的债券市场研究和券种选择、定量分析师的定量投资策略研究，结合本基金产品定位及风险控制的要求，在权限范围内制定具体的投资组合方案；
5. 基金经理根据基金投资组合方案，向集中交易室下达交易指令；
6. 集中交易室执行基金经理的交易指令，对交易情况及时反馈，对投资指令进行监督；
7. 基金经理对基金投资组合及资金运用情况进行跟踪，并根据市场变化、实际交易情况及各分析师的追踪研究和建议，在权限范围内及时调整投资组合；
8. 定量分析师负责开发和完善内部风险控制系统，并完成有关投资风险监控报告；
9. 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

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

## （六）业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准是 MSCI China A 指数，债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。

$$\text{基金业绩比较基准} = \text{MSCI China A 指数} \times 65\% + \text{上证国债指数} \times 35\%$$

\* MSCI China A 指数：摩根斯坦利资本国际—中国 A 股指数。

本基金管理人认为，本基金的业绩比较基准所引述 MSCI China A 指数和上证国债指数符合下列条件：

- 1、合理、透明，为广大投资者所接受；
- 2、有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；
- 3、业绩基准的编制和发布有一定的历史；
- 4、业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

## （七）投资限制

- 1、本基金的投资组合遵循以下限制：
  - 1) 持有一家上市公司的股票，市值不超过基金资产净值的 10%；
  - 2) 投资于股票资产的比例不低于基金资产的 50%、不高于基金资产的 80%；
  - 3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
  - 4) 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；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
  - 5) 运用基金财产进行权证投资时，不得有下列情形：
    - a) 在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
    - b) 持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。
    - c) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，超过该权证的百分之十。
  - 6) 运用基金财产投资于资产支持证券时，除了遵守上述已有投资比例限制外，还将遵守下述有关限制：
    - a) 本基金投资于资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券总规模的 10%。
    - b) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。
    - c) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%。
    - d) 同一基金管理公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。
    - e) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。
  - 7) 法律、法规或中国证监会规定的其他限制。
- 2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金的基金财产不得用于下列投资或活动：
  - 1) 承销证券；
  - 2) 向他人贷款或提供担保；
  - 3) 从事承担无限责任的投资；
  - 4) 买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
  - 6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
  - 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
  - 8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
- 3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更, 致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消, 基金管理人在履行适当程序后, 本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### (八) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的, 基金管理人应当在十个交易日内进行调整, 以符合上述限定。法律法规另有规定时, 从其规定。

#### (九) 基金投资组合报告

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

基金托管人中国银行根据本合同规定, 于 2011 年 5 月 5 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 3 月 31 日 (“报告期末”)。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,285,256,706.99	73.21

	其中：股票	1,285,256,706.99	73.21
2	固定收益投资	370,912,000.00	21.13
	其中：债券	370,912,000.00	21.13
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	85,002,808.08	4.84
6	其他各项资产	14,484,167.41	0.83
7	合计	1,755,655,682.48	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	26,528,408.20	1.52
C	制造业	468,336,645.34	26.89
C0	食品、饮料	14,675,924.60	0.84
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	72,742,573.74	4.18
C5	电子	25,101,910.68	1.44
C6	金属、非金属	145,877,352.43	8.37
C7	机械、设备、仪表	195,679,266.39	11.23

C8	医药、生物制品	14,259,617.50	0.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	52,447,629.00	3.01
F	交通运输、仓储业	8,205,112.89	0.47
G	信息技术业	172,850,423.04	9.92
H	批发和零售贸易	106,191,547.19	6.10
I	金融、保险业	258,899,585.38	14.86
J	房地产业	128,457,355.95	7.37
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	63,340,000.00	3.64
	合计	1,285,256,706.99	73.78

### 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	601989	中国重工	10,000,000	131,900,000.00	7.57
2	600406	国电南瑞	3,199,818	106,489,943.04	6.11
3	600016	民生银行	15,000,000	83,850,000.00	4.81
4	600585	海螺水泥	1,950,066	79,016,674.32	4.54
5	000002	万科A	9,000,000	78,210,000.00	4.49
6	600415	小商品城	2,000,000	63,340,000.00	3.64
7	000063	中兴通讯	1,970,750	59,122,500.00	3.39
8	600970	中材国际	1,199,900	52,447,629.00	3.01

9	600030	中信证券	3,599,950	50,291,301.50	2.89
10	601601	中国太保	2,000,000	44,240,000.00	2.54

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	268,232,000.00	15.40
3	金融债券	102,680,000.00	5.89
	其中：政策性金融债	102,680,000.00	5.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	370,912,000.00	21.29

#### 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	0801047	08央票47	1,700,000	170,272,000.00	9.77
2	080213	08国开13	1,000,000	102,680,000.00	5.89
3	1001060	10央票60	1,000,000	97,960,000.00	5.62

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**8、投资组合报告附注**

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

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

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,876,143.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,278,686.78
5	应收申购款	329,337.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,484,167.41

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允 价值(元)	占基金资 产净值比 例(%)	流通受 限情况 说明
----	------	------	--------------------	----------------------	------------------

1	601989	中国重工	131,900,000.00	7.57	筹划重大事项
---	--------	------	----------------	------	--------

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2011 年 3 月 31 日。

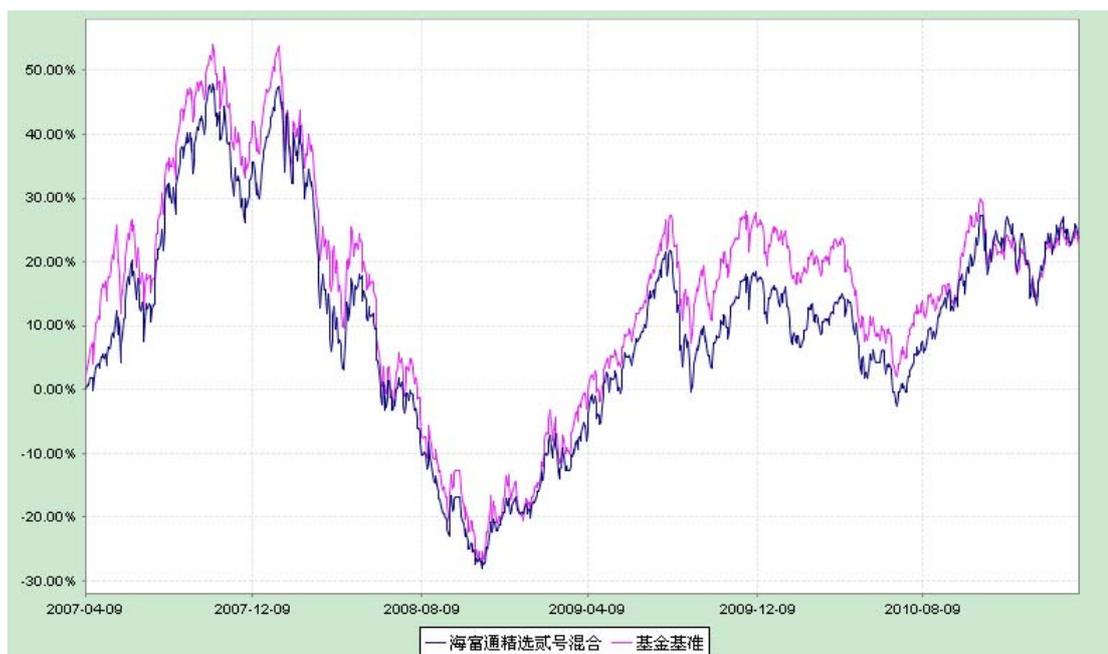
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率标准差 (2)	业绩比较基准收益率 (3)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2007 年 4 月 9 日 (基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日	39.60%	1.52%	46.49%	1.49%	-6.89%	0.03%
2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 12 月 31 日	-42.36%	1.74%	-45.76%	1.91%	3.40%	-0.17%
2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 12 月 31 日	44.65%	1.34%	57.89%	1.32%	-13.24%	0.02%
2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 12 月 31 日	5.26%	1.10%	-3.92%	1.01%	9.18%	0.09%
2007 年 4 月 9 日 (基金合同生效日)至 2011 年 3 月 31 日	23.85%	1.43%	22.71%	1.45%	1.14%	-0.02%

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

(2007年4月9日至2011年3月31日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定，即股票投资 50%-80%，债券投资 20%-50%，权证投资 0-3%；并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。同时满足第 14 章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

## 十三、 基金的财产

### （一） 基金资产总值

本基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款及其他投资等的价值总和。

### （二） 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。

### （三） 基金财产的账户

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

### （四） 基金财产的保管与处分

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

## 十四、 基金资产的估值

### （一） 估值目的

本基金估值的目的是为了准确、真实地反映本基金所持有金融资产和所承担金融负债的公允价值，并准确计算出本基金的经营收益，为本基金的申购、赎回等交易提供公允的价值基础。

### （二） 估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （三） 估值对象

本基金基金所持有的金融资产和所承担的金融负债。

### （四） 估值方法

#### 1、 股票估值方法

##### （1） 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

##### （2） 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

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

### （3）有明确锁定期股票的估值

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

## 2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘净价估值。

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按有交易的最近交易日所采用（原为债券收盘价计算得到）的净价估值。

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

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

## 3、权证估值：

### （1）配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

### （2）认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

### **（五）估值程序**

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

### **（六）暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

### **（七）基金份额净值的确认**

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

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

### **（八）估值错误的处理**

- 1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（不含本数）内发生

差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时，并及时进行公告。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### **（九） 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资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### **（十） 特殊情形的处理**

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，国家会计政策变更、市场规则变更等，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。

3、如果法律、法规、规章及中国证监会另有规定的，从其规定。

## **十五、 基金的收益与分配**

#### **（一） 基金收益的构成**

基金收益包括：

1. 买卖证券差价；
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；

3. 银行存款利息；
4. 已实现的其他合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

## （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## （三）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如投资者选择采取红利再投资方式的，分红再投资部分以分红当日经除权后的基金份额净值为计算基准确定再投资份额；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；

- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补前期亏损后，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，基金收益分配每年不超过 12 次；
- 7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、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、支付方式（及有关手续费）等内容。

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

## （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。
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，注册登记机构可以自动将该基金份额持有人的现金红利按权益登记日经除息后的基金份额净值转为基金份额。

## 十六、 基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

#### 1、与基金运作有关的费用

##### 1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费；

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 3) 与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列

入当期基金费用。

## 2、与基金销售有关的费用

### 1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

### 2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

### 3) 转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的转换”一章。

### 4) 销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

## 3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

## (二) 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资产的损失，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。

## (三) 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。

## (四) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

# 十七、 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。

- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## （二） 基金的审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券从业资格的会计师事务所及其具有证券从业资格的注册会计师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时，须事先征得基金管理人同意；
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，经基金托管人（或基金管理人）同意并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 个工作日内公告。

## 十八、 基金的信息披露

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至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一） 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

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

新内容提供书面说明。

## （二） 基金份额发售公告

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

## （三） 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

## （四） 基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## （五） 定期报告

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

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

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

3. 基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，

编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## （六）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

1. 基金份额持有人大会的召开；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14. 重大关联交易事项；
15. 基金收益分配事项；

16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 基金变更、增加、减少基金代销机构；
20. 基金更换基金注册登记机构；
21. 基金开始办理申购、赎回；
22. 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 基金份额上市交易；
27. 基金份额持有人大会的决议
28. 中国证监会规定的其他事项。

#### **(七) 信息披露事务管理**

- 1、 基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。
- 2、 基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。
- 3、 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，供公众查阅、复制。
- 4、 基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

## 十九、 基金的风险揭示

### （一） 市场风险

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

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

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

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

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

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

### （二） 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。

### （三） 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。尽管本基金将坚持分散化投资和精选个股的原则,且基金管理人还将通过一系列措施加强对流动性风险的防范和控制,但不能保证完全避免此类风险。

此外,开放式基金在我国发展历史不长,在证券市场波动加剧时,基金投资者的赎回需求可能在短时间内大幅度增加,特别是可能发生巨额赎回的情形。我国股票市场在下跌时经常出现交易量急剧减少的情况,如果这时出现较大规模的基金赎回申请,可能造成基金仓位调整和资产变现困难,加剧流动性风险。

#### **(四) 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。

#### **(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) 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、 基金的终止与清算

### （一） 基金的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二） 基金的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

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

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

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

#### 3、清算程序

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

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(8) 对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、 基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人权利与义务

#### 1、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) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；

- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- 9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规及基金合同;
- 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、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动;
- 5) 执行基金份额持有人大会的决议;
- 6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金,办理基金备案手续;
- 2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产;
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;
- 5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;
- 6) 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、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- 7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议

- 和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
  - 9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
  - 10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
  - 11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
  - 12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
  - 13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
  - 14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
  - 15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
  - 16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2) 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) 办理基金备案手续；
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人

分配基金收益；

- 7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 9) 依法接受基金托管人的监督；
- 10) 编制中期和年度基金报告；
- 11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- 15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费;
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- 4) 在基金管理人职责终止时, 提名新的基金管理人;
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
- 6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 2、 基金托管人的义务

- 1) 安全保管基金财产;
- 2) 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
- 3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
- 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;
- 5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整和独立;
- 6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- 7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 8) 按照基金合同的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;
- 9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予以保密, 不得向他人泄露;
- 10) 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的相关内容出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规

定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- 12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- 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) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- 19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- 20) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

##### **1、 召开事由**

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4) 更换基金管理人、基金托管人；
- 5) 变更基金类别；
- 6) 变更基金投资目标、范围或策略；

- 7) 变更基金份额持有人大会程序;
- 8) 本基金与其他基金合并;
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
- 10) 法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

## 2、 召集方式

- 1) 除法律法规或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。

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

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

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

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

- 4) 代表基金份额 10%(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前

30 日报中国证监会备案。

- 5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。
- 6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少应载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4) 会务常设联系人姓名、电话；
- 5) 权益登记日；
- 6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

### 4、会议的召开方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持

有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

- 2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- 3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；
- 4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- 5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、本基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 5、 议事内容与程序

### 1) 议事内容及提案权

- (1) 议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。
- (2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需

由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2) 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 6、 表决

1、 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

## 2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 特别决议

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

### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结

果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## 8、 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### (五) 基金合同解除和终止的事由、程序

出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后终止：

- 1) 基金份额持有人大会决定终止；
- 2) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

本基金终止后，须按法律法规和本基金合同对基金进行清算。中国证监

会对清算结果批准并予以公告后本基金合同终止。

#### **(六) 争议解决方式**

- 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通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。
- 3) 除争议所涉内容之外，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。

#### **(七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构办公场所查阅；投资者可以按工本费购买本基金合同的复制件或复印件，也可直接登录基金管理人的网站（[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)）进行查阅。本基金合同的正本存放在基金管理人、基金托管人的住所。

## **二十二、 基金托管协议的内容摘要**

### **(一) 托管协议的当事人**

#### **1、 基金管理人**

名称：海富通基金管理有限公司

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

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

邮政编码：200120

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：持续经营

## 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

### (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1.1 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1)、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2)、对基金投融资比例进行监督；

3)、对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4)、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5)、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

(1) 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

(2) 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

(3) 如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的投资总监批准。

6)、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7)、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

行监督和核查。

1.3 基金托管人在上述第（一）、（二）项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

1.4 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

## 2、 基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

2.1 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

2.3 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相

关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

### (三) 基金财产的保管

#### 3.1 基金财产保管的原则

- 1)、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2)、基金托管人应安全保管基金财产,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3)、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4)、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。
- 5)、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### 3.2 基金合同生效前募集资金的验资和入账

1)、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的,由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资,并出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上(含 2 名)中国注册会计师签字方为有效。

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

#### 3.3 基金的银行账户的开设和管理

- 1)、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2)、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。
- 3)、本基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4)、基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《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。

#### 3.4 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料,并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 3.5 基金证券账户和资金账户的开设和管理

1)、基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2)、本基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户;亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3)、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4)、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 3.6 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 3.7 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。

### 3.8 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## （四）基金资产净值计算和会计核算

### 4.1 基金资产净值的计算和复核

1)、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2)、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5)、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的

0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6)、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

8)、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 4.2 基金会计核算

### 1)、基金账册的建立

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

### 2)、会计数据和财务指标的核对

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

### 3)、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编

制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后10个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

## （五） 基金份额持有人名册的保管

### 5.1 基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1)、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2)、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

- 3)、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册;
- 4)、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

#### 5.2 基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册,基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册,基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

#### 5.3 基金份额持有人名册的保管

基金托管人按应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册,基金管理人应及时向中国证监会报告,并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理费用给予补偿。

### (六) 争议解决方式

6.1 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

6.2 基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

6.3 除争议所涉的内容之外,本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

### (七) 托管协议的修改和终止

#### 7.1 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行变更。变更后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

#### 7.2 托管协议的终止

发生以下情况,本托管协议应当终止:

- 1)、《基金合同》终止;
- 2)、本基金更换基金托管人;

- 3)、本基金更换基金管理人;
- 4)、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

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

### (一) 资料寄送服务

#### 1. 投资者对账单

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

#### 2. 其他相关的信息资料

介绍国内外金融市场动态、投资机会和投资产品等。

### (二) 红利再投资服务

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金,注册登记人将基金份额持有人所获红利按权益登记日经除息后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### (三) 基金间转换服务

投资者可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额。

### (四) 定期投资计划

基金管理人利用直销网点或代销网点为投资者提供定期投资的服务。通过定期投资计划,投资者可以通过固定的渠道,定期定额申购基金份额。定期投资计划的有关规则详见基金管理人公告。

### (五) 在线服务

基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理(或投资顾问)的定期

在线交流服务；基金管理人还提供网上交易服务，具体操作详见网上交易业务规则。

#### （六） 咨讯服务

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

##### 1. 客户服务电话

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

##### 2. 互联网站

公司网址：<http://www.hftfund.com>

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

#### （七） 投诉受理

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

#### （八） 网上开户与交易服务

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

## 二十四、 基金注册登记人

#### （一） 委托与更换程序

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

注册登记人的更换程序：

1. 提名：由基金管理人提名。

2. 批准：新任注册登记人报中国证监会审查资格并批准后，原任注册登记人方可退任；

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

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

**（二）基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记手续。**

### **（三）基金注册登记人概况**

基金注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：金颖

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

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

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

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

公司经营范围：

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

## 二十五、 基金管理人和基金托管人的更换

### （一） 基金管理人的更换

#### 1、 基金管理人更换的条件

有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

- 1) 基金管理人被依法取消基金管理资格；
- 2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- 3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- 4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

#### 2、 基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

- 1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。
- 2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。
- 3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后2日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。
- 4) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时

办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

- 5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。
- 6) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

## （二）基金托管人的更换

### 1、基金托管人更换的条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- 2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- 3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- 4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

### 2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

- 1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10% 以上基金份额的基金份额持有人提名。
- 2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。
- 3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后两日内在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。
- 4) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。
- 5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所

所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

## 二十六、 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。投资者也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 二十七、 备查文件

(一) 本招募说明书的备查文件包括：

- 1、 中国证监会批准海富通精选贰号混合型证券投资基金设立的文件
- 2、 《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》
- 3、 注册登记协议
- 4、 《海富通精选贰号混合型证券投资基金托管协议》
- 5、 海富通基金管理有限公司募集设立海富通精选贰号混合型证券投资基金的法律意见书
- 6、 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、 《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

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