

# 中欧稳健收益债券型证券投资基金 更新招募说明书

（2011年第1号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一一年六月

## 重要提示

本基金经 2009 年 3 月 6 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧稳健收益债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]208 号）核准，进行募集。本基金基金合同于 2009 年 4 月 24 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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前，需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（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只债券型基金，属证券投资基金中的中低风险收益品种。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2011 年 4 月 23 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪 言 .....	4
二、释 义 .....	5
三、基金管理人 .....	11
四、基金托管人 .....	20
五、相关服务机构 .....	24
六、基金的募集 .....	37
七、基金合同的生效 .....	38
八、基金份额的场外申购、转换与赎回 .....	39
九、基金份额的场内申购与赎回 .....	49
十、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记 .....	56
十一、基金的投资 .....	58
十二、基金的业绩 .....	72
十三、基金的财产 .....	74
十四、基金资产的估值 .....	75
十五、基金的收益分配 .....	81
十六、基金的费用与税收 .....	83
十七、基金的会计与审计 .....	86
十八、基金的信息披露 .....	87
十九、风险揭示 .....	92
二十、基金的终止与清算 .....	96
二十一、基金合同的内容摘要 .....	99
二十二、基金托管协议的内容摘要 .....	115
二十三、对基金份额持有人的服务 .....	125
二十四、其他应披露事项 .....	127
二十五、招募说明书的存放及查阅方式 .....	129
二十六、备查文件 .....	130

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)等有关法律法规及《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了中欧稳健收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率等与投资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,或对本招募说明书做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义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指中欧稳健收益债券型证券投资基金
基金管理人或本基金管理人：	指中欧基金管理有限公司
基金托管人或本基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司
基金合同：	指《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中欧稳健收益债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
招募说明书：	指《中欧稳健收益债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
基金份额发售公告：	指《中欧稳健收益债券型证券投资基金份额发售公告》
法律法规：	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
《销售办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 25 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作出的修订
《信息披露办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订
《运作办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁

	布机关对其不时作出的修订
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构：	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者：	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
机构投资者：	指依据有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者：	指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
投资人：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
基金份额持有人：	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金销售业务：	指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
直销机构：	指中欧基金管理有限公司
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
基金销售网点：	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

- 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
- 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
- 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金基金份额的变动及结余情况的账户
- 基金合同生效日：指基金募集达到法律规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
- 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
- T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的

行为

- 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 场外或柜台：指通过深圳证券交易所以外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所
- 场内或交易所：指通过深圳证券交易所会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所
- 场外认购：指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买基金份额的行为
- 场内认购：指基金募集期内投资人通过具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位和交易所交易系统申请购买基金份额的行为
- 场内申购：指基金合同生效后，投资人通过具备办理证券交易所场内申购业务资格的深圳证券交易所会员单位和交易所交易系统，申请购买基金份额的行为
- 场外申购：指基金合同生效后，投资人通过场外销售机构申请购买基金份额的行为
- 场内赎回：指投资人通过具备办理证券交易所场内赎回业务资格的深圳证券交易所会员单位和交易所交易系统，申请卖出本基金份额的行为
- 场外赎回：指基金合同生效后，投资人通过场外销售机构申请卖出基金份额的行为
- 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
- 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司



	证券登记结算系统
系统内转托管：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
基金转换：	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
巨额赎回：	指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%
元：	指人民币元
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
基金资产总值：	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值：	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
- 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，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、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
- 3、办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
- 4、法定代表人：唐步
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006年7月19日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：陈亮
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.2亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资5,880万元人民币，占公司注册资本的49%；

国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的47%；

平顶山煤业(集团)有限责任公司出资480万元人民币，占公司注册资本的4%；

上述三个股东共出资12,000万元人民币。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。20年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

**Gianluca Trombi 先生**，中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行国际业务部主管，意大利籍。曾任摩根士丹利（米兰）投资银行部总监、意大利金融机构小组主管；摩根士丹利（伦敦/米兰）投资银行部执行总监；瑞士联合银行（苏黎世）金融机构小组副总裁；毕马威会计师事务所（咨询业务·米兰）公司/战略金融服务资深经理；毕马威会计师事务所（审计业务·米兰）资深审计师。

**Guido Masella 先生**，中欧基金管理有限公司董事，意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利籍。曾任意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

**陈金占先生**，中欧基金管理有限公司董事，国都证券有限责任公司副总经理，中国籍。历任中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

**Barry Livett 先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司(International Securities Consultancy Ltd.) 咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

**刘桓先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

**肖微先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

## 2、基金管理人监事会成员

**廖海先生**，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

**刘中先生**，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

**刘玫女士**，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商

投资促进中心项目经理、加拿大DESROSIERS-LOMBARDI-DOLBEC注册会计师事务所审计师、美国GENERAL EASTERN TRADING 公司财务经理。

### 3、公司高级管理人员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

**刘建平先生**，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，15年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长；中国证券监督管理委员会基金监管部副处长；上投摩根基金管理有限公司督察长。

**朱彦先生**，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学经济学学士，15年以上证券从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工，海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管，海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理，北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理，国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理、上海长阳路证券营业部总经理。

**徐红光先生**，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。北京大学管理学硕士，11年以上证券从业经验。历任上海汽车集团财务公司证券部研究员，华安基金管理公司市场业务部总监助理，上投摩根基金管理公司上海销售部总监、总经理助理兼销售部总监。

**黄桦先生**，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理，中国籍。复旦大学经济学硕士，21年以上证券及基金从业经验。曾先后就职于上海爱建信托公司、上海万国证券公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券有限责任公司等金融机构。历任光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部总监及信息技术部总监。

### 4、本基金基金经理

#### （1）现任基金经理

**聂曙光先生**，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理，中国籍。复旦大学企业管理专业硕士，6年证券从业经验。历任南京银行债券分析师，兴业银行上海分行债券投资经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理兼研究员（主要负责宏观、债券研究）。现任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（2010年5月10日起至今）、中欧增强回报债券型证券投资基金基金经理（2010年12月2日起至今）。

## （2）历任基金经理

**刘杰文先生**，于2009年4月24日至2009年12月15日期间担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。

**林钟斌先生**，于2009年12月15日至2011年4月8日期间担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。

## 5、公司投资决策委员会成员

公司投资决策委员会的成员为：公司投资总监周蔚文先生、公司总经理刘建平先生、公司研究部总监林钟斌先生、基金经理沈洋先生、基金经理苟开红女士、基金经理聂曙光先生。其中投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## （三）基金管理人的职责

### 1、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- （1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- （2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （3）发售基金份额；
- （4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （5）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- （8）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制中期和年度基金报告；

（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（15）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（17）按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### **（四）基金管理人承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺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。



2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将基金管理人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）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行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

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。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### **（五）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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### **（六）基金管理人的内部控制制度**

1、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。

## 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。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政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

(2) 监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

(3) 督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

(4) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

(5) 风险控制委员会：负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

(6) 业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

## 3、内部控制的措施

(1) 部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书

和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

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基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

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

截至 2010 年 12 月 31 日，中国建设银行实现净利润 1350.31 亿元，较上年同期增长 26.39%。手续费及佣金净收入 661.32 亿元，较上年同期增长 37.61%。年化平均资产回报率为 1.32%，年化加权平均净资产收益率为 22.61%；净利息收益率为 2.49%。信贷资产质量继续稳定向好，不良贷款较上年末实现“双降”，拨备覆盖率大幅提高至 221.14%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874台，拥有员工313,867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评委2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

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

## 2、主要人员情况

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

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

## 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉

持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年3月31日，中国建设银行已托管189只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

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

### 3、内部控制制度及措施

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

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

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

#### 2、监督流程

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

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

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构：

###### 1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

联系人：陈亮

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

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

###### 2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

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

##### （2）代销机构

###### 1) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

电话：010-67596139

传真：010-66275654

客服电话：95533

联系人：王琳

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### 2) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

办公地址：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

法定代表人：刘安东



电话：010-68858095

传真：010-68858116

联系人：陈春林

客服电话：95580

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

3) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

电话：021-52629999

联系人：吴敏卿

客服电话：95561

网址：<http://www.cib.com.cn>

4) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：兰奇

客服电话：95555

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

5) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：王斌

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

6) 中国民生银行股份有限公司

住所：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：董文标

联系人：董云巍

联系电话：010-58351666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

7) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

8) 广东发展银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市农林下路83号

法定代表人：董建岳

电话：020-3832256

传真：020-87310955

联系人：李晓鹏

客服电话：400-830-8003

网址：<http://www.gdb.com.cn/>

9) 中国光大银行股份有限公司

住所：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：010-68560312

联系人：李伟

客服电话：95595

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

10) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9、10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9、10层

法定代表人：常喆

电话：010-84183390

传真：010-64482090

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

网址：<http://www.guodu.com>

11) 光大证券股份有限公司

住所：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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：4008888788, 10108998

网址：<http://www.ebscn.com>

12) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：961133 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：肖中梅

公司网址：<http://www.gf.com.cn>

13) 国信证券股份有限公司

住所：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 1010 号国际信托大厦 9 楼

法人代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

14) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、  
17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、  
24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌、庞晓芸

客服电话：400-8888-555，95513

网址：<http://www.htlhzq.com>

15) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：王霖

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客服电话：95538

网址：<http://www.qlzq.com.cn>

16) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：李清怡

客服电话：021-962505

网址：<http://www.sw2000.com.cn>

17) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：上海浦东新区民生路1199弄正大五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565783

联系人：谢高得

客服电话：4008888123

网址：<http://www.xyzq.com.cn>

18) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568888

传真：010-66568536

联系人：田薇

客服电话：4008-888-888

网址：<http://www.chinastock.com.cn>

19) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

网址：<http://www.newone.com.cn>

20) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：<http://www.csc108.com>

21) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

电话：010-62267799-6416

传真：010-62294601

联系人：张智红

客服电话：4008-000-562、010-62294600

网址：<http://www.ehongyuan.com.cn>

22) 海通证券股份有限公司

住所：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

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553

网址：<http://www.htsec.com>

23) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：陈敬达

全国免费业务咨询电话：95511

开放式基金业务传真：0755-82433794

联系人：郑舒丽

联系电话：4008866338

网址：<http://www.PINGAN.com>

24) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法人代表：凤良志

联系人：李飞

联系电话：0551-2207936

联系传真：0551-2207965

客服电话：95578, 4008888777

网址：<http://www.gyzq.com.cn>

25) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服热线：010-66045678

传真：010-66045500

联系人：林爽

联系人电话：010-66045608

网址：<http://www.txsec.com>、<http://www.txjjin.com>

26) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号良友大厦

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：祝幼一

客服热线：4008888666

传真：021-62566568

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

网址：<http://www.gtja.com>

27) 广发华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

传真：0591-87841150

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

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

28) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

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



深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

客服热线：4008-001-001

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

网址：<http://www.essences.com.cn>

29) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

传真：010-63080978

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

网址：<http://www.cindasc.com>

30) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

客服热线：95597

传真：025-84579763

联系人：万鸣

联系电话：025-83290979

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

31) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服热线：400-8888-128

传真：021-68767880

联系人：徐可

联系电话：021-68761616

网址：www.tebon.com.cn

32) 英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦西区 11 楼 1105B

法定代表人：赵文安

客服热线：4008-698-698

传真：0755-83007167

联系人：王睿

联系电话：0755-83007069

网址：www.ydsc.com.cn

33) 中信证券股份有限公司

住所：广东省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：北京市朝阳区新源里 16 号琨莎中心 16 层

法定代表人：王东明

客服热线：400-666-5589

传真：010-84865560

联系人：陈忠

联系电话：010-84683893

网址：www.citics.com

34) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路 758 号 24 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

法定代表人：郭林

客服热线：021-63340678

传真：021-62878783

联系人：陈敏

联系电话：021-32229888-3121

网址：www.ajzq.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

## 2、场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

### （二）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法人代表：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

### （三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张鸿

经办会计师：薛竞、张鸿

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2009 年 3 月 6 日证监许可[2009]208 号文核准募集。募集期为 2009 年 3 月 23 日至 2009 年 4 月 17 日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 2,152,411,566.06 份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为 16,594 户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2009 年 4 月 24 日正式生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 八、基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于本基金的场外申购和赎回业务。

### （一）场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务：

- 1、本基金管理人的直销网点。
- 2、不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告。

### （二）场外申购与赎回的开放日及办理时间

- 1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理，具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的3个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。
- 2、申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，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。
- 3、若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。
- 4、本基金自2009年4月30日起开始办理场外赎回业务；自2009年5月7日起

开始办理场外申购业务。

### （三）场外申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回；
- 4、“全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；
- 5、当日的申购与赎回申请可以在当日的交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （四）场外申购与赎回的程序

- 1、申购和赎回的申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。
- 2、申购和赎回申请的确认

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

- 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定



的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人，该退回款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金管理人在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

在发生巨额赎回的情形时，赎回的处理办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

### （五）场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T+2 日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以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，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （六）场外申购与赎回的限制

#### 1、申购金额的限制

场外申购时，代销网点每个账户单笔申购的最低金额为 1000 元人民币。

直销网点每个账户首次申购的最低金额为 10000 元人民币，追加申购单笔最低金额为 10000 元人民币；已在直销网点有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。

#### 2、赎回份额的限制

场外赎回时，赎回的最低份额为 5 份基金份额；基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 5 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

## （七）场外申购费用和赎回费用

### 1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

A类基金份额的申购费率如下：

单笔金额（M）	收费标准
M < 100 万元	0.80%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.50%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%
M ≥ 500 万元	单笔 1000 元

C类基金份额不收取申购费用。

### 2、赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的 25% 归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

A类基金份额的赎回费率如下：

持有年限（N）	收费标准
N < 1 年	0.10%
1 ≤ 年 N < 2 年	0.05%
N ≥ 2 年	0

C类基金份额不收取赎回费。

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## （八）场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

### 1、申购份额与赎回金额的处理方式：

（1）申购份额、余额的处理方式：场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以有效申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；

(2) 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 2、本基金申购份额的计算：

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

### (1) A类基金份额计算

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

例：某投资人投资 40000 元申购本基金，申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额=40000 元

净申购金额=40000/(1+0.8%)=39682.54 元

申购费用=40000-39682.54=317.46 元

申购份额=(40000-317.46)/1.0400=38156.29 份

即：某投资人投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则可得到 38156.29 份基金份额。

### (2) C类基金份额计算

C类基金不收取申购费，申购费率为零。计算公式如下：

申购金额=申购净金额

申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资人投资 40000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额=净申购金额=40000 元

申购份额=40000/1.04=38461.54 份

即：某投资人投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400

元，则可得到 38461.54 份基金份额。

### 3、本基金赎回支付金额的计算：

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

#### (1) A 类基金赎回金额计算

赎回总额=T 日申请份额\* T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额\* 赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某投资人赎回 10000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.0160=10160

赎回费用=10160×0.1%=10.16 元

赎回金额=10160-10.16=10149.84 元

即：投资人赎回本基金 10000 份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10149.84 元。

#### (2) C 类基金赎回金额计算

C 类基金份额不收取赎回费。

计算公式如下：

赎回金额=赎回当日基金份额净值\*赎回份额

例：某投资人赎回 1 万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10000×1.0160=10160

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10160 元。

### 4、基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值=计算日基金资产净值总额/计算日发行在外的基金份额总数。

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，

由此产生的误差在基金财产中列支。

T日的基金份额净值在当日收市后计算并在次日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （九）暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，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资产估值情况。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。此时，本基金的转出申请将按同样方式处理：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的

部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。但对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将自动视为取消赎回，而不会延至以后的开放日做延期赎回处理。

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

## （十二）重新开放申购或赎回的公告

- 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。
- 2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。
- 3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。
- 4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

## （十三）基金的转换

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

## （十四）定期定额投资计划

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

#### **（十五）基金的冻结和解冻**

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。



## 九、基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

### （一）投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （二）使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

### （三）场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单（有可能进行调整或变更）可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

### （四）申购与赎回的办理时间

1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理，具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的3个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2、申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，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。

3、若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、本基金自2009年4月30日起开始办理场内赎回业务；自2009年5月7日起开始办理场内申购业务。

#### （五）场内申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购，份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、“全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### （六）场内申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够基金份额余额，否则赎回申请无效。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回有效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。通常情况下, T日提交的有效申请,投资人可在T+2日到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,申购款项将退回投资人账户,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后,基金托管人按有关规定将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情况下,对于场内赎回部分,当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。关于“巨额赎回的认定”和“巨额赎回的公告”参照第八章相关内容规定。

#### (七) 场内申购和赎回的数额限制

- 1、单笔场内申购的最低金额为1,000元。
- 2、基金管理人、深交所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况,在不违反相关法律法规规定的前提下,调整上述限制。如调整上述限制的,基金管理人必须在调整3个工作日前至少在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。
- 3、申购份额、余额的处理方式:本基金的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。
- 4、赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元,赎回金额保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失

由基金财产承担。

### （八）申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

A类基金份额的申购费率如下：

单笔金额（M）	收费标准
M<100万元	0.80%
100万元≤M<200万元	0.50%
200万元≤M<500万元	0.30%
M≥500万元	单笔1000元

C类基金份额不收取申购费用。

2、投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

A类基金份额场内赎回费率统一为0.10%。

C类基金份额不收取赎回费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （九）场内申购份额和赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

（1）A类基金份额计算：

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

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

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

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例1：某投资人通过场内投资10,000元申购本基金，对应的申购费率为0.8%，

假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 0.8\%) = 9920.63 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9920.63 / 1.025 = 9,678.66 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9,678 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,678 * 1.025 = 9,919.95 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,919.95 - 79.37 = 0.68 \text{ 元}$$

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,678 份，退款 0.68 元。

## （2）C 类基金份额计算

C 类基金不收取申购费，申购费率为零。计算公式如下：

$$\text{申购金额} = \text{申购净金额}$$

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

例 2：某投资人通过场内投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 10,000 / 1.025 = 9,756.10 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9756 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,756 * 1.025 = 9,999.90 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,999.9 = 0.10 \text{ 元}$$

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9756 份，退款 0.10 元。

## 2、基金赎回金额的计算

### （1）A 类基金赎回金额计算

$$\text{赎回总金额} = \text{T 日赎回份额} * \text{T 日基金份额净值}$$

赎回费用=赎回总金额\*赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10,000\*1.148 =11,480 元

赎回费用=11,480\*0.1% =11.48 元

净赎回金额=11,480-11.48=11,468.52 元

即：投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,468.52 元。

(2) C 类基金赎回金额计算：

C 类基金份额不收取赎回费。

计算公式如下：

赎回金额=赎回当日基金份额净值\*赎回份额

例：某投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回金额=10,000\*1.148 =11,480 元

即：投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,480 元。

3、T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在次日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

**(十) 场内申购与赎回的登记结算**

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（十一）办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行。

（十二）有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第八章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

## 十、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### （一）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。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。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，按基金注册登记机构规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （二）基金份额的登记

- 1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。
- 2、登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的基金份额如需办理场外赎回，应当办理跨系统转登记后方可实施。
- 3、登记在注册登记系统中的基金份额可直接申请场外赎回。登记在注册登记系统中的基金份额如需办理场内赎回，应当办理跨系统转登记后方可实施。

### （三）系统内转托管

- 1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。
- 2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。



3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回的会员单位（席位）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### （四）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

本基金根据宏观经济的运行状况和金融市场的运行趋势，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券精选，动态优化债券组合，力争实现基金资产的长期稳定增长。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：固定收益类资产（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券，可转换债券（含可分离债）、资产支持证券和货币市场工具等）占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证资产占基金资产净值的比例不高于 3%。基金保留的现金以及投资于剩余期限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%。

### （三）投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，结合严谨、规范化的基本面研究和积极主动的投资风格，自上而下地进行债券类属配置、债券组合久期配置和期限结构配置；同时，综合考量企业债、公司债、短期融资券的信用评级、流动性、供求关系、收益率水平等因素，自下而上地精选个券。本基金也将通过运用久期偏离、息差套利、新股认购等动态增强收益策略提高投资组合收益。

#### 1、资产配置策略

在进行债券类资产的组合配置时，本基金将以中欧稳健收益债券基金资产配置记分卡评分体系为基础，通过分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，动态优化大类金融资产比例。

记分卡提供了一个分析体系，基金经理和投资决策委员会可通过该体系确定影响证券市场前景的一系列变量，跟踪变量的变化，将结果归入相应的评分体系并形成资产配置计划。在资产配置中引入记分卡评分体系，公司可以明确规定监控哪些变量，以评估证券市场的前景，并采取相应的投资策略。

中欧稳健收益债券基金资产配置记分卡，从以下四个方面对证券市场前景做出评估：

- (1) 宏观经济趋势
- (2) 债券收益率
- (3) 股票市场
- (4) 市场情绪

以上四个方面的具体分析方法详述如下：

- (1) 宏观经济趋势

我们确定了两个不同的维度来分析宏观经济的最新发展趋势，以确定其处于加速、平稳还是减速状态，即实际经济增长率和物价动态。

- 1) 经济增长，物价上升，得分低
- 2) 经济调整，物价下降，得分高

- (2) 债券收益率

资产配置记分卡考虑的第二个因素是债券收益率。尤其关注债券市场基准的10年期国债收益率、央票收益率、铁道债收益率。

债券收益率分数是以下三个方面的综合得分：

- 1) 现行债券收益率与历史比较：如果处于历史收益率的高位区间，得分高；如果处于历史收益率的低位区间，得分低
- 2) 债券收益率与存贷款利率、银行资金成本比较：如果接近贷款利率，得分高；如果接近存款利率、银行资金成本，得分低
- 3) 10年期AAA级企业债（铁道债、国电债等）与10年期国债的收益率利差比较：利差越大，得分越高；利差越小，得分越低

- (3) 股票市场

资产配置记分卡考虑的第三个因素是股票市场的中期前景。居民财富增加，资产主要在股票、债券、银行存款上配置，因此，股票与债券的行情有一定相关

性。

我们通过综合考虑企业盈利能力与估值来评价股票市场的中期前景。企业盈利能力的来自于各个行业的研究员，估值来自于研究部数量分析师的统计。

- 1) 企业盈利能力预期下降，估值高，对债券市场有利，得分高
- 2) 企业盈利能力预期上升，估值低，对债券市场不利，得分低

#### (4) 市场情绪

资产配置评分系统的第四个因素是市场情绪及其对市场表现的支持度。尤其是在中短期，投资者强烈积极的的情绪是债市的强大推动力，因此应与其他因素一起加以考虑，判断市场的吸引力。

为了判断市场的投资热情，我们考虑两个独立的因素。一个是10年期国债买盘报价收益率的下降速度；另一个是新债投标的认购倍数。10年期国债买盘报价收益率的下降速度：下降速度越快，说明市场情绪越高；新债投标认购倍数：认购倍数越高，说明市场情绪越高。

- 1) 市场情绪高，得分高
- 2) 市场情绪低，得分低

加总宏观分数，债券收益率分数，股票市场分数和市场情绪分数这四个方面的得分即可得到资产配置总评分，同时也决定了最终资产配置计划。在投资总监（CIO）的监督下，基金经理可以在资产配置范围内，根据市场变化、有利的投资机会和短期市场热点，自由决定并调整资产配置。

## 2、债券类属资产配置策略

不同类型的债券在收益性、流动性和信用风险上存在差异，各种因素会导致某类债券相对其他类债券价值高估或者低估，增持价值低估的债券板块，减持价值高估的债券板块。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期以及利差平均值的偏离，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

## 3、动态增强收益策略

### （1）久期管理策略

久期管理策略是债券组合最基本的投资策略，也是本基金最重要的策略。久期管理策略的目的在于通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

本基金将密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标，对宏观经济运行趋势及其引致的财政、货币政策变化做出判断，并对未来市场利率趋势进行分析与预测，运用数量化工具确定合理的债券组合久期。

### （2）骑乘策略

骑乘收益率曲线策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券期限剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。

### （3）息差策略

息差策略是指在回购利率低于债券收益率的情况下，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上是国债回购放大套利策略，基本原理就是先投入初始资金购买国债现券，并用所持有的国债现券进行回购，回购后的资金再购买国债现券或金融债、企业债现券，如此多次操作至回购期末，出售全部现券，并偿还回购融入资金。

### （4）收益率利差策略

利差策略是指通过对两个期限相近的债券的利差进行分析，判断利差水平的未来走势，进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平将会有所变化时（不管变大还是变小），可以卖出收益率即将走高的债券品种同时买入收益率即将走低的债券品种，通过两债券利差的缩小获得投资收益。利差策略实际上是某种形式上的利率互换，也是相对价值投资的一种常见策略。

## 4、企业债投资策略

本基金通过对宏观经济运行、企业所有制性质、企业所属行业、企业净资产规模、企业现金流特点、企业发展前景、企业偿债能力、建设项目质量、市政债券级别等多重因素的综合考量进行信用评级，并在信用评级的基础上，建立企业债债券池。基于既定的目标久期、信用利差精选个券进行投资。

## 5、可转债投资策略

可转债投资策略是本基金在国债收益率偏低的市场环境下最重要的投资策略。

### （1）可转债投资策略

本基金将着重对可转债相应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的转债进行重点投资，并根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转债投资组合。

在可转债的到期收益率为正、绝对价格在面值附近、底价升水小于 30%、平价升水小于 50%的市场环境中，买入持有策略是本基金最重要的可转债投资策略。

### （2）可转债转换为基础股票的策略

当发生以下情况时，本基金将把相关的可转债转换为基础股票：在转股期内，基金所持有可转债的实际转股价格明显低于基础股票市场交易价格时，即存在明显的市场套利机会，本基金将通过转股实现获益；当存在可转债在变现过程中可能出现较大的变现损失时，本基金将通过转股来保障基金资产的流动性；当由于基础股票价格上涨且满足赎回触发条件时，本基金将通过转股来保障已有收益；以及其他通过转股能够有效保障或提升基金份额持有人利益的情况。

本基金持有由可转债转换而得的基础股票的期限不超过 30 个交易日。

## 6、股票投资策略

本基金股票投资策略仅指新股认购策略，包括 IPO 和增发新股的认购策略。本基金认为股票一、二级市场之间存在一定的价差是暂时现象，股票投资策略只是一种阶段性投资策略。

新股申购的具体选择标准：根据内外部新股研究报告，选择行业前景看好、公司基本面良好、一级定价偏低的新股进行申购。具体地，行业选择上，主要是选择符合国家产业政策、当前及未来 1-2 年市场需求不断扩大的行业；公司基本面良好，主要是指公司处于行业龙头或者领先地位、盈利能力和偿债能力优秀；一级定价偏低，主要是指一级发行定价与预期上市后的二级价格有较大的差距，存在增值空间。锁定期超过 6 个月甚至更长期限的新股，因为不可控因素很多，不参与申购。

本基金通过新股认购（含增发新股认购）所持有的股票，在其上市后持有时间不超过 90 个交易日。

## 7、权证投资策略

本基金不主动投资权证但可持有可转债认购所获得的权证，在其上市后持有时间不超过 30 个交易日。与新股认购策略一样，本基金认为权证投资策略也是一种阶段性投资策略。

本基金的权证投资以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求当期稳定的基金资产收益。

### （四）投资决策

#### 1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业经济运行趋势；证券市场走势。

#### 2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易，及严格控制。

#### 3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，主要负责评价并批准不同基金的资产配置提案；协同风险控制委员会，审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险，并在必要时做出修改。

投资总监全面负责公司基金投资管理业务，协调所有基金的投资活动，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理负责通过与研究部的通力合作，推动研究业务并拟定资产配置提案提交投资决策委员会；并负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

#### 4、投资决策程序

投资决策过程应由投资研究部在投资决策委员会领导下驱动。研究部是公司投资决策的基石，将为各层次的投资决策提供主要依据。该部分为两部分：基本面研究与投资业绩和风险分析，主要职能包括宏观经济研究、行业研究、上市公司股票基本面研究、市场和策略研究、债券研究以及组合投资业绩和风险评价。公司将广泛建立与证券公司和其他研究机构的交流渠道，并最大限度地推动专业先进的内部研究能力的开发。

具体而言，公司的投资决策过程主要分为以下几步：

基本面研究员立足于详尽的货币信贷、粮食能源价格和各种商品的销售数量和价格数据的统计分析，建立自己的分析模型债券收益率曲线进行模拟和对个券进行精确定价等等。数量研究员制作针对基金资产的投资业绩和风险评价报告。在此基础上，由投资研究部透彻分析宏观经济动态、政府政策、金融市场状况以及收益率曲线因素等方面后，定期向投资决策委员会上报资产配置提案；

投资决策委员会根据议事规则对上述资产配置提案进行讨论和评价后形成资产配置决议；

投资总监负责将上述决议落实为每只基金的资产配置方案并与各基金经理沟通。投资总监亦须协调和监管各基金的投资决策执行情况；

各基金经理负责按照投资决策委员会的要求和有关债券池的研究报告对其基金投资组合制定计划；

各基金经理在其权限范围内直接执行投资决策，超出基金经理权限但属于投资总监权限范围内的投资决策只能经投资总监批准后执行；超出投资总监权限的指令经投资决策委员会批准后执行；

研究部应利用多种模型评价各基金的投资业绩和风险并出具周报和月报呈送投资总监、投资决策委员会、风险控制委员会和总经理，以便其必要时提出反馈或调整意见。

#### （五）业绩比较基准



本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。

本基金债券投资比例不低于80%，根据相关法律法规定义，本基金为债券型基金。由于本基金股票投资只是作为债券投资的有益补充，比例相对较低，所以基金基准里就不考虑股票部分。由于本基金债券投资范围不仅包括国债，而且也包括企业债和金融债等，而中信标普全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数，能较好地反映本基金在债券方面的投资范围，所以本基金选择中信标普全债指数作为基金比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场变化情况以及本基金的投资范围和投资策略，调整该基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，应履行适当的程序并予以公告。

## （六）风险收益特征

本基金属于债券型基金，属证券投资基金中的中低风险收益品种，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。

## （七）投资限制

### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- （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）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- （5）本基金投资的固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于20%；
- （6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

- （7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （8）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （10）本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （11）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （12）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （13）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；

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行

的股票或者债券；

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

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### （八）基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （九）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

#### （十）基金投资组合报告

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

基金托管人建设银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金 2011 年第 1 季度报告，所载数据截至 2011 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	30,691,588.70	4.22

	其中：股票	30,691,588.70	4.22
2	固定收益投资	662,093,519.20	91.05
	其中：债券	662,093,519.20	91.05
	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	20,816,325.46	2.86
6	其他各项资产	13,582,546.06	1.87
7	合计	727,183,979.42	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	16,195.00	0.00
C	制造业	20,643,580.00	3.15
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	20,522,325.00	3.13
C7	机械、设备、仪表	121,255.00	0.02
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,907,000.00	0.44
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	6,560,000.00	1.00
G	信息技术业	564,813.70	0.09
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-

J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		30,691,588.70	4.68

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	002540	亚太科技	610,000	20,502,100.00	3.13
2	601018	宁波港	2,000,000	6,560,000.00	1.00
3	600795	国电电力	950,000	2,907,000.00	0.44
4	601519	大智慧	25,465	564,813.70	0.09
5	601799	星宇股份	3,000	68,820.00	0.01
6	601616	广电电气	2,000	36,520.00	0.01
7	002541	鸿路钢构	500	20,225.00	0.00
8	002554	惠博普	500	16,195.00	0.00
9	002553	南方轴承	500	15,915.00	0.00
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	-	-
2	央行票据	30,012,000.00	4.57
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	422,462,254.00	64.39
5	企业短期融资券	150,236,000.00	22.90
6	可转债	59,383,265.20	9.05
7	其他	-	-
8	合计	662,093,519.20	100.92

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	1180005	11微矿集团债	500,000	50,020,000.00	7.62
2	098043	09盐国资债	500,000	50,015,000.00	7.62
3	1080019	10贵投债	400,000	40,360,000.00	6.15
4	1181081	11美克CP01	400,000	40,140,000.00	6.12
5	1081334	10苏恒力CP01	400,000	39,952,000.00	6.09

**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) 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	4,887,246.68
3	应收股利	-
4	应收利息	7,433,899.38
5	应收申购款	1,261,400.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,582,546.06

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	---------	--------------

1	125709	唐钢转债	10,739,800.00	1.64
2	110003	新钢转债	10,191,600.00	1.55
3	110007	博汇转债	9,168,015.00	1.40
4	113001	中行转债	3,211,800.00	0.49
5	110009	双良转债	2,951,680.20	0.45
6	110078	澄星转债	1,161,666.00	0.18
7	125731	美丰转债	238,958.00	0.04
8	113002	工行转债	119,760.00	0.02
9	128233	塔牌转债	14,317.90	0.00

(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	002540	亚太科技	20,502,100.00	3.13	网下新股申购
2	601519	大智慧	564,813.70	0.09	网下新股申购

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日2009年4月24日，基金业绩截止日2011年3月31日。

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 中欧稳健收益债券型证券投资基金 A 类

阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2009. 4. 24-2009. 12. 31	4. 51%	0. 12%	0. 40%	0. 04%	4. 11%	0. 08%
2010. 1. 1-2010. 12. 31	8. 81%	0. 15%	2. 00%	0. 07%	6. 81%	0. 08%
2011. 1. 1-2011. 3. 31	-0. 37%	0. 15%	0. 79%	0. 04%	-1. 16%	0. 11%
2009. 4. 24-2011. 3. 31	13. 29%	0. 14%	3. 22%	0. 06%	10. 07%	0. 08%

数据来源：中欧基金 中证指数

#### 中欧稳健收益债券型证券投资基金 C

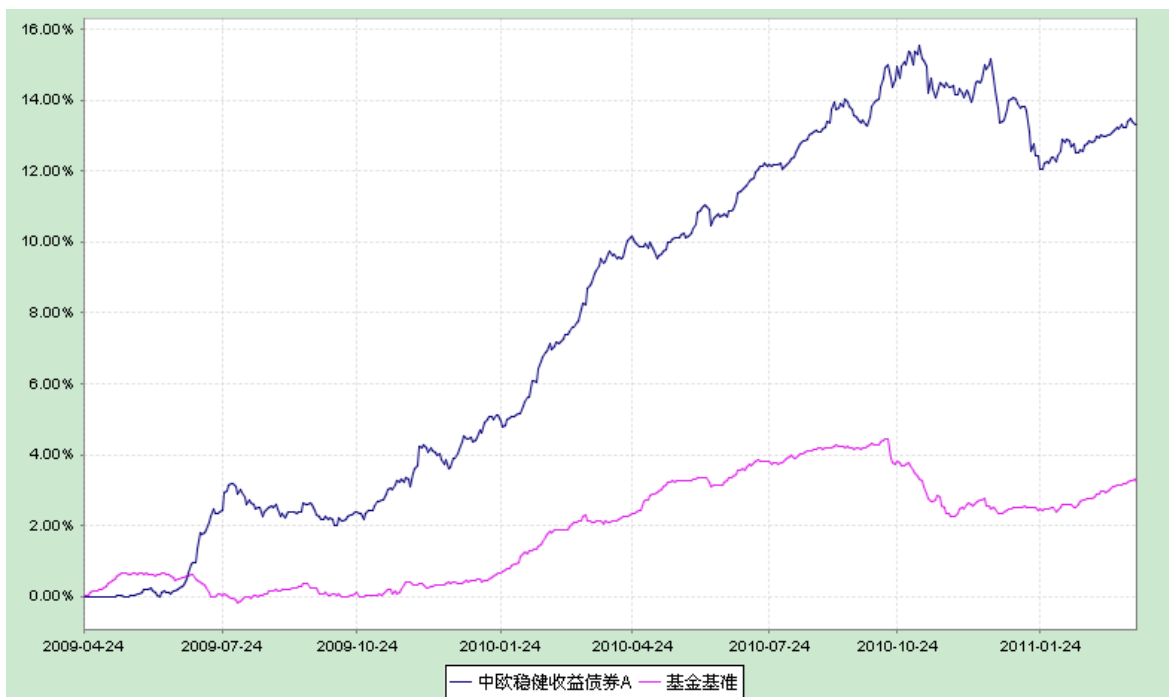
阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2009. 4. 24-2009. 12. 31	4. 18%	0. 12%	0. 40%	0. 04%	3. 78%	0. 08%
2010. 1. 1-2010. 12. 31	8. 35%	0. 15%	2. 00%	0. 07%	6. 35%	0. 08%
2011. 1. 1-2011. 3. 31	-0. 48%	0. 15%	0. 79%	0. 04%	-1. 27%	0. 11%
2009. 4. 24-2011. 3. 31	12. 34%	0. 14%	3. 22%	0. 06%	9. 12%	0. 08%

数据来源：中欧基金 中证指数

### 2. 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

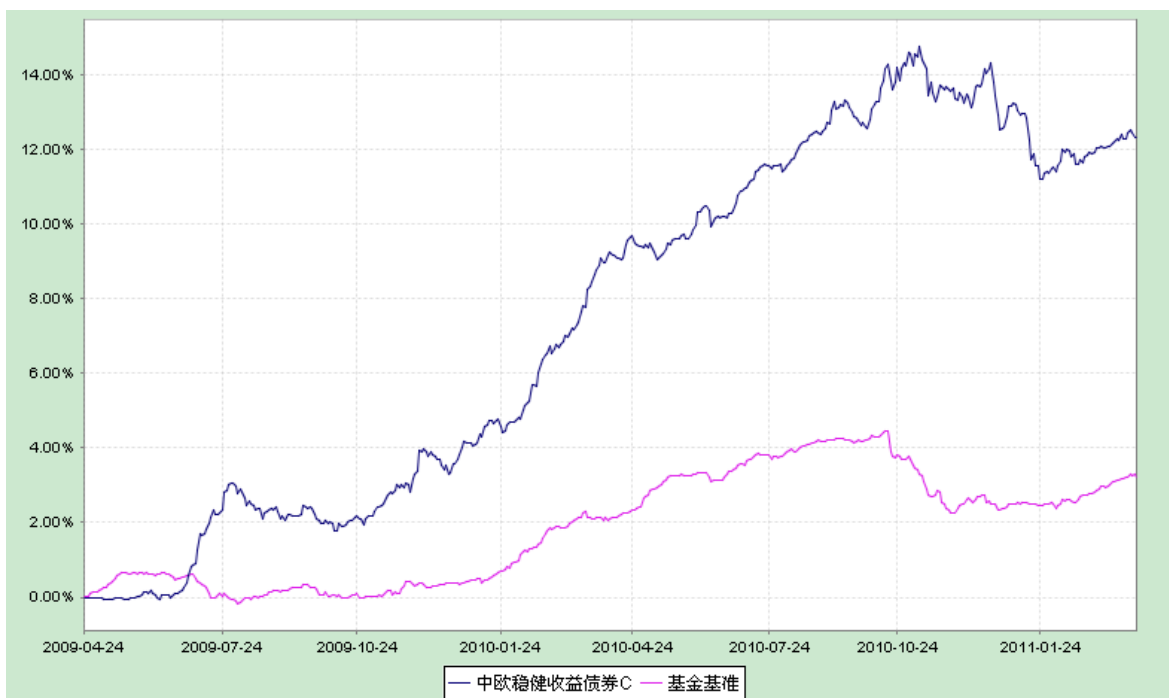
#### 中欧稳健收益债券型证券投资基金 A





数据来源： 中欧基金 中证指数

### 中欧稳健收益债券型证券投资基金 C



数据来源： 中欧基金 中证指数

## 十三、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的处分

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

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

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

## 十四、基金资产的估值

### （一）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。

### （二）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

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

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

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

#### 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时

更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

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

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### **(六) 暂停估值的情形**

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值。

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金净值的确认

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

### （八）特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 十五、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 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；
- 5、持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。
- 3、本基金收益每年最多分配4次，全年基金收益分配比例不低于已实现净收益的60%；
- 4、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；
- 5、本基金场外认购、申购基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

场内认购、申购的基金份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其

他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

- 6、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 8、基金收益分配后基金份额净值不能低于初始面值；
- 9、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**

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### **（五）收益分配的时间和程序**

- 1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
- 2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、本基金从C类份额的基金财产中计提销售服务费；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

本基金基金合同终止基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3、销售服务费

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售费率} \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

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

### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。**

#### **（六）基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金募集所在的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

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

## 十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 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。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制基金招募说明书

并在基金份额发售的 3 日前登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## （二）基金合同、托管协议

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

## （三）基金份额发售公告

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

## （四）基金合同生效公告

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

## （五）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

- 1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；
- 2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；
- 3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## （六）基金份额申购、赎回价格公告



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

### （七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

- 1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；
- 2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；
- 3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；
- 4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。
- 5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### （八）临时报告与公告

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门 9、负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

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

#### （十）基金份额持有人大会决议

#### （十一）中国证监会规定的其他信息

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十九、风险揭示

### （一）市场风险与对策

由于经济和政治环境、产业和行业状况、上市公司基本面等方面的变化，可能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动，进而影响基金份额净值。市场风险主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、债券收益率曲线风险、再投资风险以及可转债投资波动性风险等。

为控制此类风险，本基金管理人将努力加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率走势和行业发展趋势，以此作为资产配置和证券选择的依据；本基金管理人的风险控制系统实施对从个股/个券到全部组合等风险源的全面风险管理，从而得以时时监控组合风险敞口，及时识别风险源并调整投资组合；本基金将通过构建多样化组合并限制单只证券过高持仓以避免个股/个券过度风险；岗位风险管理职能方面：本基金管理人的业绩和风险评价小组自行开发风险管理系统并将定期出具业绩和风险评价报告，重点股票的波动性、贝塔系数、风险值、跟踪误差和债券的剩余期限、久期、凸性等指标；基金经理和投资总监将负责实时监控组合风险头寸并决定是否调整投资组合；风险控制委员会负责每月审阅业绩和风险评价报告。

### （二）流动性风险与对策

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，进而影响基金份额净值。

为控制此类风险，本基金管理人的投资组合管理和交易系统设置了预警和自动控制功能，以便对基金交易中可能存在的流动性风险发出警报；基金运营部将与代销机构、托管行保持高效沟通以及时预测资金流动；基金经理将每日依据基金运营部提供的信息监控基金的净现金头寸和资金流入/流出情况；业绩和风险评

价小组定期计算流动性及可能存在的风险，并出具报告提交基金经理、投资总监和风险控制委员会。

### （三）管理风险与对策

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

为控制此类风险，本基金管理人将充分发挥中外合资基金管理公司在国际化和本土化方面的双重优势，吸取国内外同行业在投资管理方面的经验教训，引进外资股东的先进管理经验和管理技术，建立优秀的管理团队和专业团队；同时，本基金管理人实施积极的人才战略，通过外部引进、内部培训、科学考核、有效激励等多种方式不断提高团队的经营管理水平和投资研究能力，并根据实际情况引进新的管理技术和方法，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报；投资总监、投资决策委员会对基金经理助理、基金经理和投资总监等各级岗位的基金投资分别实施不同的投资交易限制以及重要交易的逐级授权制度，从而确保实现对于管理风险的有效监督和管理。

### （四）信用风险与对策

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

为控制此类风险，本基金管理人将只选择资信状况良好的机构作为本基金的交易对手，只投资于具备较高信用评级的债券并尽可能通过多样化持债回避企业债信用风险。

### （五）本基金特有的风险与对策

本基金属于债券型基金，将维持较高的债券持仓比例。如果债券市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。

本基金主要通过投资于承担一定信用风险、具有较高息票率的债券，实现基金资产的长期稳定增长。在债券投资中，本基金特有的风险主要来自两个方面：

一是对宏观经济趋势、政策以及债券市场基本面研究是否准确、深入。二是对企业债券的优选和判断是否科学、准确。基本面研究及企业债券分析的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。三是本基金所投资的企业债券承载的信用风险要高于高信用等级的债券（如国债），若债券发行人出现违约、不能按时或全额支付本金和利息，将导致基金资产损失，发生信用风险。

## （六）其它风险

### 1、操作风险与对策

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

为控制此类风险，本基金管理人将在充分考虑内外部环境的基础上，建立科学、严密、高效的内部控制体系；投资组合管理和交易系统中设置了交易前的自动限制和控制功能，以防止主观和客观的错误交易和违规交易。中央交易室每日提交交易报告以便投资总监和风险控制委员会及时发现操作中存在的问题并予以修正。同时，本基金管理人注重提高员工专业水平，并加强员工职业道德教育，以促进合规文化的形成。

### 2、技术风险与对策

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

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

### 3、其它风险与对策

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争及代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

为控制这类风险，本基金管理人建立了突发紧急事件处理制度以及完备的灾

难恢复计划，以防范和控制不可抗力因素造成的风险。

## 二十、基金的终止与清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

### （二）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

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

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

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

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；



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

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

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

## 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

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

务的外部机构；

(12)在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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

(2) 办理基金备案手续；

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

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

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

## 2、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- （1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （2）监督基金管理人对本基金的投资运作；
- （3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- （4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- （5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （6）依法召集基金份额持有人大会；
- （7）按规定取得基金份额持有人名册资料；
- （8）法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- （1）安全保管基金财产；
- （2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- （3）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- （4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- （7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，

在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（8）对基金财务会计报告、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，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（10）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（13）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

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

（19）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（22）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；



（6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

（7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

4、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

## （二）基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、召开事由：

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

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬

标准的除外；

- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

（2）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或

收费方式：

- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

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

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

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

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

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

### 4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

## 5、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，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会的基金份额持有人在权益登记日持有基金份额的统计显示，其所持有的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

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

2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

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

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

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

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

6、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。

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

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

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

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

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

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

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

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

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权

代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

## 2) 通讯方式开会

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

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### 2) 特别决议

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

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 8、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两名基金份额持有人代表与基金管理人或基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### （2）通讯方式开会

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

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金

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

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

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### （三）基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

#### 2、基金财产的清算

##### （1）基金财产清算组

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

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

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

##### （2）基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：



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

### (3) 清算费用

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

### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款 1) — 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### (5) 基金财产清算的公告

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

### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## (四) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决

的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

#### **（五）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，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

邮政编码：200120

法定代表人：唐步

成立日期：2006年7月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]102号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：郭树清

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：固定收益类资产（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券，可转换债券（含可分离债）、资产支持证券和货币市场工具等）占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证资产占基金资产净值的比例不高于 3%。基金保留的现金以及投资于剩余期限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%。

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

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

- (4) 本基金投资的固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证资产占基金资产净值的比例不高于 3%；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (7) 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%；
- (8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (9) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (10) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (11) 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；

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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

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

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。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

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

5、本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险

处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

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

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

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

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

### **（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查**

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，核查事项包括基金托管

人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管



理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存于中国证券登记结算有限责任公司的开放式基金认购专户，该账户由基金管理人委托的登记结算机构开立并管理。

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

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

## 3、基金银行账户的开立和管理

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

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

（3）基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

## 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

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

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

## 5、债券托管专户的开设和管理

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

## 6、其他账户的开立和管理

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

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

## 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

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

## 8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表

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

### （五）基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

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

#### 2、复核程序

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

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

### （六）基金份额持有人名册的保管

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

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基

金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。

基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

### （七）争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

### （八）托管协议的修改与终止

#### 1、托管协议的变更程序

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

#### 2、基金托管协议终止出现的情形

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

## 二十三、对基金份额持有人的服务

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

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿向有交易的基金份额持有人以书面形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿对所有的基金份额持有人以书面形式寄送年度对账单。

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

场内认购、申购的基金份额的分红方式为现金红利，基金份额持有人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

### （三）基金间转换

本基金存续期间，基金管理人可接受本基金份额持有人的申请，将其持有的基金份额转换为本基金管理人管理的另一基金的基金份额。具体情况以届时发布的公告为准。

### （四）定期投资计划

基金管理人可通过销售渠道为基金份额持有人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金份额持有人可以定期定额申购基金份额。具体情况以届时发布

的公告为准。

#### **（五）在线服务**

基金份额持有人可以通过本基金公司的网站 <http://www.lcfunds.com> 定制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

#### **（六）查询与咨询服务**

中欧基金公司客服中心为基金份额持有人提供 7 \* 24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客服电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录公司网站 <http://www.lcfunds.com> 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一—周五 9：00—17：00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

#### **（七）投诉受理**

基金份额持有人可以拨打客服中心电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和代销机构的人员及其服务。

## 二十四、其他应披露事项

以下为本基金管理人自2010年10月24日至2011年4月23日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧稳健收益债券型证券投资基金2010年第3季度报告	2010.10.27
2	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰联合证券有限责任公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	2010.10.27
3	中欧基金管理有限公司关于新增中国光大银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2010.11.8
4	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国光大银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	2010.11.8
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国光大银行股份有限公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	2010.11.8
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司开展的基金网上申购费率优惠活动的公告	2010.11.8
7	中欧稳健收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2010年第2号）	2010.12.7
8	中欧稳健收益债券型证券投资基金更新招募说明书（2010年第2号）	2010.12.7
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与德邦证券有限责任公司开展的基金网上申购费率优惠活动的公告	2010.12.13
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在德邦证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	2010.12.13
11	中欧基金管理有限公司关于旗下基金在德邦证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	2010.12.13
12	中欧基金管理有限公司关于新增德邦证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	2010.12.13
13	中欧稳健收益债券型证券投资基金第四次分红预告	2010.12.16
14	中欧稳健收益债券型证券投资基金第四次分红公告	2010.12.21
15	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行有限责任公司开展的基金网上申购费率延期优惠活动的公告	2010.12.31
16	中欧基金管理有限公司旗下基金2010年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2011.1.1
17	中欧稳健收益债券型证券投资基金2010年第4季度报告	2011.1.22

18	中欧基金管理有限公司关于督察长变更的公告	2011.2.22
19	中欧基金管理有限公司关于新增英大证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	2011.2.23
20	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在英大证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	2011.2.23
21	中欧基金管理有限公司关于新增中信证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	2011.3.15
22	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	2011.3.15
23	中欧基金管理有限公司关于注册登记（分TA）系统升级的通知	2011.3.18
24	中欧稳健收益债券型证券投资基金 2010 年年度报告	2011.3.30
25	中欧稳健收益债券型证券投资基金 2010 年年度报告摘要	2011.3.30
26	中欧基金管理有限公司关于中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理变更公告	2011.4.8
27	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	2011.4.15
28	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	2011.4.15
29	中欧基金管理有限公司关于新增爱建证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	2011.4.15
30	中欧稳健收益债券型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	2011.4.20



## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金销售机构等办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会批准中欧稳健收益债券型证券投资基金募集的文件
- 2、《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧稳健收益债券型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》
- 4、《中欧稳健收益债券型证券投资基金托管协议》
- 5、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、中国证监会规定的其他文件

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2011年6月7日