

东方核心动力股票型开放式证券 投资基金招募说明书(更新) (2011年第2号)

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

日 期：二〇一二年二月

【重要提示】

东方核心动力股票型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2009年4月14日中国证券监督管理委员会《关于核准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的批复》(证监许可【2009】302号)和《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2009】301号)的核准募集。本基金基金合同于2009年6月24日正式生效。

东方基金管理有限责任公司(以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”)保证《东方核心动力股票型开放式证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”)的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,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。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日(财务数据未经审计),本招募说明书其他所载内容截止日为2011年12月24日。

本基金托管人中国银行股份有限公司已于2012年1月18日对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

目 录

一、绪 言.....	4
二、释 义.....	4
三、基金管理人.....	8
四、基金托管人.....	18
五、相关服务机构.....	22
六、基金的募集与基金合同的生效.....	34
七、基金份额的申购与赎回.....	35
八、基金的投资.....	44
九、基金的业绩.....	54
十、基金的财产.....	55
十一、基金资产的估值.....	56
十二、基金的收益与分配.....	59
十三、基金的费用与税收.....	60
十四、基金的会计与审计.....	62
十五、基金的信息披露.....	62
十六、风险揭示.....	65
十七、基金的终止与清算.....	67
十八、基金合同的内容摘要.....	69
十九、托管协议内容摘要.....	82
二十、对基金份额持有人的服务.....	89
二十一、其他应披露事项.....	92
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	93
二十三、备查文件.....	93

一、绪 言

《东方核心动力股票型开放式证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定以及《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

本《招募说明书》根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释 义

在《东方核心动力股票型开放式证券投资基金招募说明书》中,除非文义另有所指,下列词语具有如下含义:

基金或本基金:	指东方核心动力股票型开放式证券投资基金;
基金合同或本基金合同:	指《东方核心动力股票型开放式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《东方核心动力股票型开放式证券投资基金招募说明书》及其定期更新;

发售公告:	指《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议:	指《东方核心动力股票型开放式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;
《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日起实施的《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日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订;
《运作办法》:	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订;
《信息披露办法》:	指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订;
元:	指人民币元;
基金管理人:	指东方基金管理有限责任公司;
基金托管人:	指中国银行股份有限公司;
基金合同当事人:	指受基金合同约定,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
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:	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为东方基金管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构;
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：	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者
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：	指募集结束，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；
定期定额投资计划：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
赎回：	指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
巨额赎回	指本基金单个开放日，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%
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;
非交易过户:	指不采用申购、赎回等基金交易方式, 将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到其他投资者基金账户的行为
指令:	指基金管理人在运用基金资产进行投资时, 向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
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:	指东方基金管理有限责任公司
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接受基金管理人委托, 代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构;
销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;
基金销售网点:	指基金管理人的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或其它媒体;
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办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的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、证券持有期间产生的公允价值变动及因运用基金财产带来的成本和费用的节约以及其他合法收入;
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	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值;
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、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、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: 东方基金管理有限责任公司

住所: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人: 崔伟

总经理: 单宇

成立日期: 2004 年 6 月 11 日

注册资本: 壹亿元人民币

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：110000007042263

联系人：吕日

电话：010-66295888

股权结构

持股单位	出资金额（人民币）	占总股本比例
东北证券股份有限公司	4600 万元	46%
中辉国华实业（集团）有限公司	1800 万元	18%
渤海国际信托有限公司	1800 万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800 万元	18%
合 计	10000 万元	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。董事会下设合规与风险控制委员会；本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、研究部、基金管理部、交易部、专户管理部、金融工程部、营销策划部、渠道销售部、机构理财部十五个职能部门及上海分公司；本公司设督察长，分管监察稽核部，负责公司的监察稽核工作。

（二）基金管理人主要人员情况

1. 董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。1993年4月至1996年7月，任中国人民银行调查统计司干部、副主任科员、主任科员；1996年7月至1997年10月，任中国人民银行办公厅主任科员、秘书处副处级秘书；1997年10月至2000年4月，任中国证监会办公厅（办公室）秘书处党组书记、副处长、处长；2000年4月至2004年9月，任中国人民银行东莞中心支行党委委员、副行长，汕头中心支行党委书记、行长；2004年9月至2008年9月，任中国证监会海南监管局党委委员、副局长，党委书记、局长；2008年9月至2010年8月，任中国证监会协调部副主任；2010年8月至今，任吉林大学商学院教师。

杨树财先生，董事，硕士研究生，中国注册会计师，高级会计师，吉林省高级职称评委会委员，中国证券业协会财务会计委员会执行委员。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师，吉林会计师事务所副所长，东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监，东方基金管理有限责任公司董事长；现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长。

齐伟丽女士，董事，会计师。历任中国计算机软件与技术服务总公司工程师，中软总公司多维公司会计师，北京宏世通达商贸集团财务部长，中辉投资有限公司财务总监，新疆中建投资有限责任公司总经理，中天高科特种车辆有限公司副总经理，北京中辉阳光房地产开发有限公司董事；现任北京京发置业有限公司监事，北京宏世通达商贸集团副总经理。

彭铭巧女士，董事，经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员，特区时空杂志社编辑，国泰君安证券公司海口营业部研究员，海航集团有限公司证券业务部研究室经理，海航集团财务有限公司投资银行部理财主管；现任渤海国际信托有限公司投资部总经理。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任廊坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省商贸有限公司董事长，河北省机械工业供销协会名誉理事长，河北省商业会计学会名誉会长。

单宇先生，董事，大学本科。15年以上证券及基金从业经历，历任吉林省信托投资公司证券管理总部证券投资管理部经理，吉林省宝路达投资管理公司总经理，天治基金管理有限公司筹备组成员、副总经理、监事长，东北证券有限责任公司副总裁，东北证券股份有限公司副总裁、合规总监；现任本公司总经理。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业(集团)总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员(副部级)，中国工商银行党委副书记、副行长、中央金融工委委员(副部级)，工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长(中组部任命、副部级)、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任

吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

2. 监事会成员

何俊岩先生，监事会主席，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任东北证券股份有限公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券股份有限公司财务总监，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司副总裁，吉林省注册会计师协会副会长，吉林省证券业协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事。

李绍科先生，监事，大专，高级经济师。历任北京新富投资集团有限公司副总经济师，联合置地房地产开发有限公司总经济师，北京莱富建设有限公司总经济师，北京绿城投资有限公司总经济师；现任中辉国华实业（集团）有限公司总经济师。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，17年金融、证券从业经历；现任本公司监察稽核部经理。

3. 其他高级管理人员

单宇先生，总经理，简历请参见董事介绍。

王兴宇先生，副总经理，美国宾西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士；具有6年基金从业经历和5年保险从业经历，曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书，先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司。

仝岩女士，副总经理，管理学硕士；曾任金融街控股有限公司董事会办公室主任、服务中心主任，长城人寿保险公司筹备组副组长，金融街商会副秘书长，北京华融文化投资有限公司总经理。2008年4月加盟本公司，任董事会秘书、总经理助理。

吕日先生，督察长，吉林大学经济学院政治经济学专业博士研究生，高级经济师。曾担任吉林省证券公司长春北国之春营业部副经理、延吉证券营业部副经理、营业机构管理部经理；东北证券股份有限公司总裁助理兼营销交易管理总部总经理。2008年11月加盟本公司。

4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
----	------	----

张岗（先生）	2010年9月16日起至今	西北大学经济学博士，10年证券从业经历。历任健桥证券股份有限公司行业公司部经理，天治基金管理公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理（2006年3月-2007年4月），投资副总监、投资决策委员会委员，建信基金管理公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟本公司，现任东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理，研究部经理，投资决策委员会委员。
郑军恒（先生）	2009年6月24日至2010年9月15日任本基金基金经理	

5. 投资决策委员会成员

单宇先生：公司总经理，投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

庞飒先生：总经理助理兼投资总监，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会副主任委员。浙江大学生命科学院理学硕士学历，11年证券从业经验，曾担任申银万国证券研究所行业分析师，富国基金行业分析师，汇添富基金管理有限公司投资决策委员会委员、基金投资部副总监、高级研究员、研究主管、基金经理。2010年5月加盟本公司。

张岗先生：本基金基金经理，研究部经理，投资决策委员会委员。简历请参见本基金基金经理介绍。

于鑫先生：东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理，东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。清华大学 MBA，CFA；10年证券从业经历，曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理；2005年加盟本公司。

李骥先生：首席策略分析师，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。北京大学经济学博士，10年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟本公司，曾任研究部经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人职责

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) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。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) 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) 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) 编制季度、半年度和年度基金报告;

(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、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;

(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、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(四)基金管理人的承诺

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

- (1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
- (2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
- (3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
- (4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3. 本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利益;
- (4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- (5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6)玩忽职守、滥用职权;

(7)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

- (8)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;
- (9)贬损同行,以抬高自己;
- (10)以不正当手段谋求业务发展;
- (11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(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) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、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、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄密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。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1. 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, 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) 内部控制的主要内容

<1>控制环境

①控制环境构成公司内部控制的基础, 环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度, 组织内控设计并以身作则、积极执行, 牢固树立诚实信用和内控优先的思想, 自觉形成风险管理观念; 通过营造公司内控文化氛围, 增进员工风险防范意识, 使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查,对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任;同时,通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能,避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主透明的决策程序和管理议事规则,高效严谨的业务执行系统,以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度,严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度,确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

<2>风险评估

内部稽核人员定期评估公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素,评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

<3>组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次:董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导;

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会在董事会领导下,对公司固有资产和基金资产运作的合法合规性进行全面、重点的跟踪分析并提出改进方案,调整、确定公司的内部控制制度并评估其有效性,其目的是完善董事会的合规监控功能,建立良性的公司治理结构。

督察长负责合规与风险控制委员会决议的具体执行,按照中国证监会的规定和合规与风险控制委员会的授权对公司和基金运作的合规合法性进行监督稽核。

第二层次:公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和金融工程部、监察稽核部;

①总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构,并负责公司层面风险管理工作。

②风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准,划分和量化市场风险,并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

③金融工程部使用数量化的风险管理系统,对基金投资的绩效和风险进行数量化评估,形成基金投资的绩效评价和风险控制评价。

④监察稽核部是公司和基金运作的监察稽核部门,负责对公司和基金运作的合法合规性及内部控制制度的建立和执行情况进行监察稽核。

第三层次:各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各职能部门作为公司内部风险控制的具体实施单位,在公司各项基本管理制度的基础上,根据公司经营计划、业务规划和各部门的具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定,并严格执行,将风险控制在最小范围内。

<4>制度体系

制度是内部控制的指引和规范,制度缜密是内部控制体系的基础。

①内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

②内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

③业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

<5>信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送达适当的人员进行处理。

2. 基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、实施和维持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;

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一) 基金托管人的基本情况

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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管及投资者服务部总经理：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

截至 2011 年 9 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、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、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)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等128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) 直销机构

名称: 东方基金管理有限责任公司直销中心

住所: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人: 崔伟

联系人: 史鹏浩

电话: 010-66295921

传真: 010-66578690

网址: www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

(二) 代销机构

1. 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

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人: 肖 钢

联系人: 宋亚萍

电话: 010-66596688

传真: 010-66594946

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

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 (长安兴融中心)

法定代表人: 张建国 (代行)

联系人: 王琳

传真: 010-66275654

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

3. 中国工商银行股份有限公司

住所: 中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址: 中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

联系人: 查樱

电话: 010-66107900

传真: 010-66108013

客户服务电话: 95588

网址: www.icbc.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: 秦晓

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83077278

传真: 0755-83195109

客户服务电话: 95555

网址: www.cmbchina.com

5. 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

电话: 010-58351666

传真: 010-83914283

客户服务电话: 95568

网址: www.cmbc.com.cn

6. 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所: 北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址: 北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人: 刘安东

联系人: 陈春林

电话: 010-68858117

传真: 010-66415194

客户服务电话: 95580

网址: www.psbc.com

7. 北京银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人: 闫冰竹

联系人: 王曦

电话: 010-66223584

传真: 010-66226045

客户服务电话: 95526

网址: www.bankofbeijing.com.cn

8. 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：宋晓明

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

9. 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

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.95559.com.cn

10. 东北证券股份有限公司

住址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

11. 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

联系人：李洋

电话：010-66568888

传真：010-66568116

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

12. 中信证券股份有限公司

住所：深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京朝阳区亮马桥路 48 号

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客户服务电话：各地营业部咨询电话

网址：www.ecitic.com

13. 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

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

14. 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：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话: 021-23219275

传真: 021-23219100

客户服务电话: 021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址: www.htsec.com

15. 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

电话: 010-85130588

传真: 010-65182261

客户服务电话: 400-8888-108

网址: www.csc108.com

16. 山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

联系人: 郭熠

电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

客户服务电话: 400-666-1618

网址: www.i618.com.cn

17. 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 3 楼

法定代表人: 徐浩明

联系人: 李芳芳

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客户服务电话: 10108998

网址: www.ebscn.com

18. 东海证券有限责任公司

住所: 江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼

办公地址: 上海市浦东新区东坊路 989 号中达广场 13 楼

法定代表人: 朱科敏

联系人: 霍小菲

电话: 021-50586660-8862

传真: 021-50585607

客户服务电话: 400-888-8588

网址: www.longone.com.cn

19. 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人: 万建华

联系人: 吴倩

电话: 021-38676767

客户服务电话: 400-8888-666

网址: www.gtja.com

20. 中信金通证券有限责任公司

住所: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人: 刘军

联系人: 丁思聪

电话: 0571-85112510

传真: 0571-85783771

客户服务电话: 0571-96598

网址: www.bigsun.com.cn

21. 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

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

电话：0551-2207938

传真：0551-2207965

客户服务电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

22. 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

23. 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务电话：021-962506 或 40088-88506

网址：www.dfzq.com.cn

24. 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

25. 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路166号中保大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-68419867

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

26. 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.axzq.com.cn

27. 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133302

客户服务电话: 95536

网址: www.guosen.com.cn

28. 长江证券股份有限公司

住所: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

联系人: 李良

电话: 027-65799999

传真: 027-85481900

客户服务电话: 95579 或 4008-888-999

网址: www.95579.com

29. 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

联系人: 黄健

电话: 0755-82943666

传真: 0755-82943636

客户服务电话: 95565、4008881111

网址: www.newone.com.cn

30. 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: 山东省济南市千佛山路3号济南商业银行四楼

法定代表人: 李玮

联系人: 吴阳

电话: 0531-68889155

传真: 0531-68889752

客户服务电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

31. 江海证券经纪有限责任公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

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: 张宇宏

电话: 0451-82336863

传真: 0451-82287211

客户服务电话: 400-666-2288

网址: www.jhzq.com.cn

32. 宏源证券股份有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人: 冯戎

联系人: 李巍

电话: 010-88085338

传真: 010-88085344

客户服务电话: 4008-000-562

网址: www.hysec.com

33. 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

联系人: 张腾

电话: 0591-87841160

传真: 0591-87841150

客户服务电话: 96326

网址: www.gfhfzq.com.cn

34. 五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：高竹

联系人：高克南

电话：0755- 82545707

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

35. 恒泰长财证券有限公司

住所：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

办公地址：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

法定代表人：赵培武

联系人：曲志诚

电话：0431-82945299

传真：0431-82946531

网址：www.cczq.net

36. 东莞证券有限责任公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：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：张运勇

联系人：苏卓仁

电话：0769-22112062

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：www.dgzq.com.cn

（三）注册登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

联系人：王广辉

电话：010-66295872

传真：010-66578680

网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

(四) 律师事务所和经办律师

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军 李晓明

(五) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所有限公司

住所：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅

电话：010-68015062

传真：010-68018480

经办注册会计师：朱锦梅、魏星

六、 基金的募集与基金合同的生效

(一) 本基金根据2009年4月14日中国证券监督管理委员会《关于核准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的批复》(证监许可【2009】302号)和《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2009】301号)的核准,并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

(二) 本基金类型：股票型

本基金存续期间：不定期

(三) 本基金募集期为：2009年5月5日至2009年6月19日

募集份额为：771,742,249.97份

有效户数为：17,585户

(四) 本基金根据《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金备案确认的函》(基金部函【2009】419号)的批准，于2009年6月24日基金合同生效。

本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

七、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回的办理场所

1. 本基金管理人的直销网点。

2. 经本基金管理人委托，具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即代销机构销售网点。目前的代销机构为中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、北京银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、江海证券经纪有限责任公司、宏源证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、五矿证券有限公司、恒泰长财证券有限公司、东莞证券有限责任公司。以上代销机构的住所同第五章所述。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

3. 投资者可通过本基金直销机构或指定的代销机构按照规定的方式进行申购或赎回。

(二) 申购和赎回的开放日及时间

1. 本基金办理日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日(本基金管理人公告暂停时除外)。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所

所交易日的交易时间。目前,上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9:30-11:30,下午 1:00-3:00。

2. 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原因,基金管理人可对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并于实施前在中国证监会指定媒体上公告。

3. 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、赎回视为下一开放日的交易申请。

4. 本基金自 2009 年 7 月 8 日开始正常申购;自 2009 年 7 月 8 日开始正常办理赎回。

(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处理时,申购确认日期在先的基金份额先赎回,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业务办理时间结束前撤销,在当日的业务办理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 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(四) 申购与赎回的程序

1. 申购与赎回的申请方式

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

T 日规定时间受理的申请,正常情况下,基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在 T+2 日后(包括该日)投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

3. 申购与赎回的款项支付

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 T 日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 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。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并提前公告。

(五) 申购与赎回的数额限制

1. 投资者每次最低申购金额为 1,000.00 元(含申购费),每次定期定额最低申购金额为 100.00 元,具体办理要求以销售渠道的交易细则为准,但不得低于基金管理公司规定的最低限额。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时,每次赎回申请不得低于 500.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 500.00 份的,在赎回时需一次全部赎回。

3. 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 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(六) 申购费用和赎回费用

1. 申购费用

本基金的申购费用由申购人承担,不列入基金资产,申购费用用于本基金的市场推广和销售等。投资者选择红利再投资转基金份额时不收取申购费用。

本基金的申购费采用前、后端收费模式,具体如下表所示:

前端收费费率如下:

申购金额(含申购费)	前端申购费率
50 万元以下	1.5%
50 万元以上(含 50 万元)-100 万元以下	1.2%
100 万元以上(含 100 万元)-500 万元以下	0.8%
500 万元以上(含 500 万元)	每笔 1,000.00 元

后端收费费率如下:

持有期限	后端申购费率
------	--------

(一年按 365 天计算)	
1 年以内	1.8%
1 年以上(含 1 年)-3 年以内	1.0%
3 年以上(含 3 年)-5 年以内	0.6%
5 年以上(含 5 年)	0

2. 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担, 赎回费用的 25% 归基金资产, 其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下:

持有期限 (一年按 365 天计算)	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年以上(含 1 年)-3 年以内	0.25%
3 年以上(含 3 年)-5 年以内	0.1%
5 年以上(含 5 年)	0

3. 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定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 3 个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。

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

(七) 申购份额与赎回金额的计算

1. 申购份额、申购费和赎回金额及赎回费的处理方式

申购份额、申购费、赎回费的处理方式: 采用截位法, 即: 保留小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍去。由此产生的误差由基金财产承担。

赎回金额的处理方式: 采用四舍五入法保留小数点后 2 位, 由此产生的误差由基金资产承担。

2. 本基金申购份额的计算

(1) 前端收费模式：前端申购费用在投资者申购基金时收取。

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用 = {申购金额 / (1 + 前端申购费率)} * 前端申购费率

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

申购达到一定金额（具体见发售公告）、申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

前端申购费用在投资者申购基金时收取。

例二：某投资者投资 4 万元申购本基金，申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择前端收费方式，则其可得到的申购份额为：

前端申购费用 = {40,000 / (1 + 1.5%)} * 1.5% = 591.13 元

净申购金额 = 40,000 - 591.13 = 39,408.87 元

申购份额 = 39,408.87 / 1.0400 = 37,893.14 份

(2) 后端收费模式：后端申购费用在投资者赎回份额时收取。

申购份额 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

后端申购费用 = 赎回份额 * 申购日基金份额净值 * 后端申购费率

后端申购费用在投资者赎回份额时收取。

例三：某投资者投资 4 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购份额 = 40,000 / 1.0400 = 38,461.53 份

3. 本基金赎回金额的计算

(1) 如果投资者在申购时选择交纳前端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用 = 赎回份额 * 赎回日基金份额净值 * 赎回费率

赎回金额 = 赎回份额 * 赎回日基金份额净值 - 赎回费用

例四：某投资者赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = $10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80$ 元

赎回金额 = $10,000 \times 1.0160 - 50.80 = 10,109.20$ 元

(2) 如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用, 则赎回金额的计算方法如下:

后端申购费用 = 赎回份额 \times 申购日基金份额净值 \times 后端申购费率

赎回费用 = 赎回份额 \times 赎回日基金份额净值 \times 赎回费率

赎回金额 = 赎回份额 \times 赎回日基金份额净值 - 后端申购费用 - 赎回费用

例五: 某投资者赎回 1 万份基金份额, 对应的赎回费率为 0.5%, 假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元, 投资者对应的后端申购费是 1.8%, 申购时的基金净值为 1.0100 元, 则其可得到的赎回金额为:

后端申购费用 = $10,000 \times 1.0100 \times 1.8\% = 181.80$ 元

赎回费用 = $10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80$ 元

赎回金额 = $10,000 \times 1.0160 - 181.80 - 50.80 = 9,927.40$ 元

4. 基金份额净值的计算公式

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当日收市后计算, 并在 T+1 日公告。基金份额净值计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。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。如遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。

(八) 申购和赎回的注册与过户登记

1. 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 日为投资者增加权益并办理注册登记手续, 投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3. 投资者 T 日赎回基金成功后, 基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4. 基金管理人可在法律法规允许的范围内, 对上述注册登记办理时间进行调整, 并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告。

(九) 巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

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%。

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进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时,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,应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该基金份额持有人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,赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权,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 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在至少一种指定媒体予以上公告。

(4)暂停接受和延缓支付:本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但延缓期限不得超过 20 个工作日,并应当在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(十) 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)基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;
- (5)法律法规规定或经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依法公告。

2. 在以下情况下,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无法支付赎回款项;
- (2) 证券交易场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) 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) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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依法公告。

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,基金管理人应依法公告并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) 如果发生暂停的时间为一天,基金管理人将于重新开放日,在至少一种指定媒体,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,基金管理人将提前两日,在至少一种指定媒体,刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近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个工作日,在至少一种指定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。

(十一) 基金转换

为方便基金份额持有人,本公司已在直销中心、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、齐鲁证

券有限公司等开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

(十二) 定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人,本基金自2009年6月30日起在齐鲁证券有限公司、7月23日起在工商银行股份有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司、2010年1月12日起在广发华福证券有限责任公司、7月7日起在安信证券股份有限公司、2011年5月17日起在中信证券股份有限公司等销售渠道开始办理定期定额投资业务(前端);通过本公司网上交易平台,于2009年7月8日起开通农行金穗卡、招行一卡通(借记卡),8月7日起开通民生银行借记卡、2010年5月21日起开通上海浦东发展银行卡和广东发展银行卡、2011年11月11日起开通中国建设银行卡等定期定额投资业务(前端),未来在各项技术条件和准备完备的情况下,将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

(十三) 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1. 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;

“司法强制执行”是指司法机关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。

2. 符合条件的非交易过户申请办理时,申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

3. 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。

4. 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。

5. 如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

八、基金的投资

(一) 投资目标

本基金的投资目标是：坚持长期投资理念，以全球视野考察中国经济、行业以及个股的成长前景，通过“核心-卫星”投资策略，把握中国经济崛起过程中的投资机遇，在控制投资风险的前提下，追求资本的长期稳定增值。

(二) 投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%—40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。

(三) 投资理念

本基金的投资理念：坚持价值投资理念，寻找具有长期竞争优势、公司治理优良、估值合理的上市公司，把握中国经济崛起过程中出现的产业升级等造就具有国际竞争力的世界级企业的投资机会。

(四) 投资策略

1. 资产配置

根据对宏观经济运行周期的研判，确定股票、债券、现金等资产的配置比例，并根据不同资产类别的收益情况进行动态调整。

2. 股票投资策略

本基金采用“核心-卫星”投资策略，分别构建“核心”与“动力”两个投资组合进行股票投资。其中核心组合的投资比例 X 控制在股票资产的 70%以上。

(1) 核心组合选择以沪深 300 指数的成分股和备选成份股为投资对象，根据中证指数有限公司发布的沪深 300 行业分类标准，结合定量与定性选股的方法，在十大类行业中选择行业地位突出、竞争优势明显并稳步增长的上市公司构建投资组合，以期获得超过沪深 300 指数的收益。

“核心组合”的定量选股方法，主要是根据增长性指标、盈利质量指标、估值水平指标

等三方面因素,根据中证沪深300行业分类方法对十大类行业分别进行筛选,然后合并建立初选库。

①增长性指标:最近一年或一个季度的主营业务收入同比增长率、近三年平均主营业务收入增长率、近三年平均息税折旧前利润(EBITDA)增长率、市盈增长比率(PEG);

②盈利质量指标:近三年平均净资产收益率(ROE)、近三年平均投资资本回报率(ROIC);

③估值指标:市盈率(P/E)、市销率(P/S)、市净率(P/B)。

在备选股票池基础上,本基金将根据以下几个方面,对公司基本面进行深入研究,选择具备长期竞争优势、稳定增长的个股,纳入核心股票组合:

①公司在行业内的地位:如公司是否属于行业龙头;是否具有较高的市场占有率;是否具有产品的定价权或者能够影响主要产品的市场价格等;

②公司的竞争优势:是否具有与行业竞争结构相适应的、清晰的竞争战略;是否拥有成本优势、规模优势、品牌优势或其它特定优势;是否在特定领域具有原材料、专有技术或其它专有资源;有较强技术创新能力;

③公司的盈利质量:如公司未来盈利的可持续性和可预测性如何;公司的盈利模式和扩张方式等;

④公司的经营管理能力:管理层对企业未来发展是否有着明确的方向和清晰的思路;是否建立了制度化的管理机制;管理层对公司的控制力如何;

⑤公司的分红机制:是否具有持续稳定高分红记录或具备持续稳定分红潜力。

(2)动力组合主要选择沪深300指数成分股和备选成分股以外、具备核心优势和高成长性的中小企业作为投资对象,并根据价值和主题两个方面进行投资。

本基金价值投资的选股标准主要包括以下几个方面:

①企业长期的竞争优势:选择在激烈的市场竞争中,能够通过成本或差异化等战略获得优于竞争对手的竞争优势,并获得超越竞争对手的市场份额或者高于行业平均水平的回报率的上市公司;

②公司的治理结构:如董事会中独立董事的比例、股权结构是否过于集中等;

③估值水平:对稳定增长的公司,以历史平均市盈率作为参考标准;对高速增长的公司以公司未来有望可达到的股价贴现值作为参考标准。

本基金主题投资主要以国际竞争力为投资标准,通过自上而下的方法,以全球视野,从资本密集、劳动密集、技术成熟等三个方面出发,结合中国现阶段的产业环境、产业政策,

考核产业的国际竞争力和未来的发展潜力。在具备国际竞争力的产业中,本基金将通过案头分析、公司实地调研等方式,挖掘出面向全球市场、有望成长为世界级企业的上市公司。通过长期持有,分享上市公司实现的盈利及增长,获得超过市场平均水平的收益。

(3) 债券投资策略

在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段,本基金将采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段,进行主动性投资。在有效控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析,确定组合整体框架;对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

(4) 权证投资策略

本基金将通过权证的股票基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,综合运用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略等策略,以达到获取权证投资收益、改善组合风险收益特征的目的。

(五) 投资管理流程

本基金采用投资决策委员会下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、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. 投资依据

(1) 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

(2) 国家产业政策与宏观经济。本基金将对国家发展战略、产业政策以及执行情况进行深入研究,在此基础上确立优先投资的行业。

(3) 上市公司的基本面及成长风险。本基金将对受益于国家产业政策的上市公司的基本面进行深入研究,分析上市公司的成长风险。将成长风险控制适当的范围内。

2. 投资分析

研究部策略研究员、股票研究员、固定收益研究员、数量研究员各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

基金经理依据策略研究员的宏观经济分析和策略建议、股票研究员的行业分析和个股研究、固定收益研究员的债券市场研究和券种选择、数量研究员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。

3. 投资决策程序

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规、本基金管理人有关规章制度确定的基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围,审批总体投资方案和重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、资产配置等总体投资方案,并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断、基金申购赎回情况和市场整体情况,构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资,按照公司权限审批流程,提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

4. 投资执行

中央交易室接受基金经理下达的交易指令。中央交易室接到指令后,首先应对指令予以审核,然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的,中央交易室可以暂不执行指令,并立即通知基金经理或相关人员。

中央交易室应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议,以便基金经理及时调整交易策略。

5. 组合监控与调整

基金管理人的风险管理部门将密切关注宏观经济和市场变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量情况,每日对组合的风险和流动性进行监控,确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平,确保组合的流动性能够满足基金份额持有人的赎回要求。

当组合中相关资产价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时,或当组合中债券品种信用评级调整导致信用等级不符合要求时,基金管理人应采取有效的措施,在合理的时间内调整组合。

风险管理部门定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况,并提出下期的操作思路,作为投资决策委员会决策的参考。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资决策程序作出调整。

(六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中证全债指数收益率 \times 20%。

鉴于本基金占权益类投资比重 70%以上的核心组合,选择沪深 300 指数成分股和备选股为投资对象,因此我们认为沪深 300 指数与本基金实际投资风格比较相似,比较适合作为本

基金股票类资产的业绩比较标准;同时考虑中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,两者均具有良好的市场代表性,因此本基金债券组合的业绩比较基准采用中证全债指数。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

(七) 风险收益特征

本基金属于股票型基金,为证券投资基金中的高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

(八) 投资禁止行为与限制

1. 禁止用本基金资产从事以下行为

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

2. 基金投资组合比例限制

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资产的非系统性风险,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) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

(5) 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%;

(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%;

(8) 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%;

(9) 本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%, 债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%-40%, 其中, 现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%, 权证投资比例不高于基金资产净值的 3%, 资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。

(10) 本基金投资于资产支持证券, 应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券;

(11) 本基金财产参与股票发行申购, 基金所申报的金额不超过基金的总资产, 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) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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。

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。

(九) 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。法律法规另有规定时, 从其规定。

(十) 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。

(十一) 基金的投资组合报告

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2012 年 1 月 18 日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 9 月 30 日（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	107,632,727.54	70.47
	其中：股票	107,632,727.54	70.47
2	固定收益投资	14,746,623.71	9.65
	其中：债券	14,746,623.71	9.65
	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	28,470,250.70	18.64
6	其他各项资产	1,892,042.50	1.24
7	合计	152,741,644.45	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	6,925,101.55	4.59

C	制造业	58,952,796.89	39.06
C0	食品、饮料	11,581,985.91	7.67
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	5,990,875.19	3.97
C5	电子	5,857,197.89	3.88
C6	金属、非金属	8,879,991.06	5.88
C7	机械、设备、仪表	13,302,877.99	8.81
C8	医药、生物制品	13,339,868.85	8.84
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,856,853.02	3.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,887,928.42	4.56
H	批发和零售贸易	8,592,911.42	5.69
I	金融、保险业	12,413,989.96	8.23
J	房地产业	5,878,975.00	3.90
K	社会服务业	316,739.84	0.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,807,431.44	1.86
	合计	107,632,727.54	71.32

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	600519	贵州茅台	35,224	6,713,342.16	4.45
2	601288	农业银行	2,046,500	5,034,390.00	3.34

3	600036	招商银行	377,600	4,176,256.00	2.77
4	600048	保利地产	400,288	3,702,664.00	2.45
5	600585	海螺水泥	215,019	3,698,326.80	2.45
6	000538	云南白药	62,200	3,514,300.00	2.33
7	002503	搜于特	102,352	3,280,381.60	2.17
8	000876	新希望	169,743	3,267,552.75	2.17
9	600271	航天信息	117,200	3,165,572.00	2.10
10	600697	欧亚集团	117,900	3,094,875.00	2.05

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	-	-
3	金融债券	9,997,000.00	6.62
	其中:政策性金融债	9,997,000.00	6.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,749,623.71	3.15
8	其他	-	-
9	合计	14,746,623.71	9.77

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	060221	06国开21	100,000	9,997,000.00	6.62

2	110015	石化转债	30,000	2,622,300.00	1.74
3	113002	工行转债	20,000	2,039,200.00	1.35
4	110016	川投转债	560	49,548.80	0.03
5	125887	中鼎转债	372	38,574.91	0.03

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) 本报告期内本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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	830,798.05
3	应收股利	-
4	应收利息	298,926.21
5	应收申购款	12,318.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,892,042.50

(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	110015	石化转债	2,622,300.00	1.74
2	113002	工行转债	2,039,200.00	1.35
3	110016	川投转债	49,548.80	0.03
4	125887	中鼎转债	38,574.91	0.03

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

九、基金的业绩

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

(一) 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009/6/24-2009/12/31	2.83%	1.56%	13.03%	1.68%	-10.20%	-0.12%
2010/1/1-2010/12/31	-6.35%	1.34%	-9.15%	1.27%	2.80%	0.07%
2011/1/1-2011/6/30	-7.73%	1.19%	-1.76%	0.99%	-5.97%	0.20%
2011/7/1-2011/9/30	-12.65%	1.09%	-12.27%	1.05%	-0.38%	0.04%

(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

东方核心动力股票型开放式证券投资基金

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

(2009年6月24日至2011年9月30日)



注：①根据《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票资产投资比例为基金资产的60%—95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的5%—40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的20%。本报告期内，本基金严格执行了《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》的相关规定。

②本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金合同生效日为2009年6月24日，截至2011年9月30日，本基金成立不满三年。

③所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

十、基金的财产

（一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金的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）基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
3. 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
4. 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。

十一、基金资产的估值

(一) 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

(二) 估值日

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

(三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

(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，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) 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，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。

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。

(4)非公开发行有明确锁定期股票按以下方法估值:

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该股票的估值价。如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价,应按以下公式确定该股票的价值:

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

其中:

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值;

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时,应于除权日对其初始取得成本作相应调整);

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价;

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数;

Dr 为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数(不含估值日当天)。

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,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净价估值;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) 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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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,按有交易的最近交易日所采用的净价估值;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) 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，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；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；因持有股票而享有的配股权、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资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金资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《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资产价值时；
3. 中国证监会认定的其它情形。

(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 0.0001 元，小数点后第 5 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。
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，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

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

十二、基金的收益与分配

(一) 收益的构成

1. 基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、

证券持有期间产生的公允价值变动以及其他收入。

2. 因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3. 期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(二) 收益分配原则

1. 基金收益分配采用现金方式, 基金份额持有人可选择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;

2. 每一基金份额享有同等分配权;

3. 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益分配每年最多 12 次, 每次收益分配最少不得低于期末可供分配利润的 50%;

4. 基金进行收益分配时, 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)不得超过 15 个工作日;

5. 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

(三) 收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

(四) 收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定, 并由基金托管人复核后确定, 基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

(五) 收益分配中发生的费用

1. 基金份额持有人选择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时免收再投资的费用。

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, 注册登记机构可将该基金份额持有人的现金红利按除息日转为基金份额。

十三、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. 因基金的证券交易或结算而产生的费用;
4. 基金合同生效以后的信息披露费用;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金合同生效以后的会计师费和律师费;
7. 基金资产的资金汇划费用;
8. 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。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。

2. 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 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。

3. 本条第(一)款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用发生的金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(三) 不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(五) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、基金的会计与审计

(一) 基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日, 如果基金在首次募集的会计年度, 基金合同生效时间不足2个月, 可以并入下一个会计年度。

2. 基金核算以人民币为记账本位币, 以人民币元为记账单位。

3. 会计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) 基金审计

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

2. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所, 须经基金托管人同意, 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日内公告;

3. 会计师事务所更换经办注册会计师, 应事先征得基金管理人同意。

十五、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及更新的招募说明书。

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) 公开澄清

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

(八) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,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。

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

十六、风险揭示

投资于本基金的主要风险有以下几方面:

(一) 市场风险

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

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

2. 经济周期因素,经济运行具有周期性的特点,宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响。基金投资于证券市场,其收益水平也会随之变化。

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

4. 上市公司的经营业绩, 上市公司的经营业绩会对其证券价格产生影响, 从而使基金投资收益受到影响。

(二) 管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素, 而使基金收益水平受到影响。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上, 例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标; 也可能表现在个券、个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

(三) 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金, 或者不能应付可能出现的投资者巨额赎回的风险。目前中国股票市场波动性较大, 在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况, 如果在此情况下出现较大规模的基金赎回申请, 基金资产则可能变现困难, 基金面临流动性风险。

(四) 特定风险

本基金为股票型开放式基金, 与其他同类基金类似, 面临上述风险。此外, 由于本基金采用“核心-卫星”投资策略, 分别构建“核心”与“动力”两个投资组合进行股票投资, 使得本基金面临特定的风险。

本基金核心组合选择以沪深 300 指数的成份股和备选成份股为投资对象, 且核心组合的投资比例控制在股票资产的 70% 以上, 当沪深 300 指数成份股和备选股以外其他股票大幅上涨时, 本基金核心组合表现可能落后于市场的综合指数表现, 本基金整体的投资收益率有可能会低于市场的综合指数表现。

本基金的核心组合与卫星组合均采用主动选股、积极投资的方式, 这增加了投资组合的风险度。在基金投资组合的风险度高于指数的情况下, 其投资收益率可能高于指数收益率, 但也有可能低于指数收益率, 其中存在一定的不确定性。

(五) 其他风险

1. 信用风险: 指基金在交易过程发生交收违约, 或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失, 影响基金收益水平, 从而带来风险。

2. 操作或技术风险: 指相关当事人在业务各环节操作过程中, 因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。

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

4. 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,影响基金收益水平,从而带来风险。

5. 其他意外导致的风险。

(六) 声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。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。

本基金投资于证券市场,基金份额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之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性及自身的风险承受能力,并对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

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

除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过基金代销机构代理销售,但是,基金资产并不是代销机构的存款或负债,也没有经基金代销机构担保收益,代销机构并不能保证其收益或本金安全。

十七、基金的终止与清算

(一) 基金合同的终止

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。

基金合同终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定,行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

(二) 基金财产的清算

1. 基金合同终止,基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组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。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等,在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

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。

十八、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人权利及义务

1. 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在本合同的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。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自行承担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编制季度、半年度和年度基金报告;
- 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、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- 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、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

2. 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根据法律法规及本合同的约定,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、半年度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按照法律法规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,其赔偿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、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

3. 基金份额持有人的权利与义务

(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依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

④按照规定要求召开基金份额持有人大会;

⑤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

- ⑥查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- ⑦监督基金管理人的投资运作;
- ⑧对基金管理人、基金托管人、基金份额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、基金合同及其他有关规定;
- 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遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则;
- ⑧法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人、合法代理人及授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1. 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和表决方式;
- 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。但根据法律法规的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,须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、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、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或调低赎回费率;

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。

2. 召集人和召集方式

(1)除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集,开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

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

(3)代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项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。

3. 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天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- ①会议召开的时间、地点和出席方式;
- 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。

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

4. 基金份额持有人出席会议的方式

(1)会议方式

①基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

②现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,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,但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

<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对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%,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召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应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符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记注册机构记录相符;

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法

规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决, 表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

① 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

② 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上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作出决定。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作出决定, 并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

④ 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, 应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

(2) 议事程序

① 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 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、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

②通讯方式开会

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

(3)基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

6. 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及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及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、终止基金合同等重大事项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)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

7. 计票

(1)现场开会

①如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

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

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

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合,则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序;如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合,则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序;如基金管理人、基金托管人经通知仍拒绝派代表监督计票的,不影响大会会议决议的效力。

8. 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议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效执行。

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

(3)基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。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。

(三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1. 基金合同的变更

(1)变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。

(2)变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并自中国证

监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形, 或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的, 可不经基金份额持有人大会决议, 而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布, 并报中国证监会备案。

2. 基金合同的终止

有下列情形之一的, 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。

基金合同终止后, 基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定, 行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

3. 基金财产的清算

(1) 基金合同终止, 基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组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。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等,在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(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。

(四) 争议的处理

1. 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
2. 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决,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,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

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。

(五) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册并对外公开散发或存放在基金管理人和基金托管人的营业场所供投资者免费查阅; 投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件; 如涉及争议事项须协商、仲裁或诉讼的, 基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

十九、托管协议内容摘要

(一) 托管协议当事人

1. 基金管理人

名称: 东方基金管理有限责任公司

住所: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人: 崔伟

总经理: 单宇

成立时间: 2004 年 6 月 11 日

批准设立机关: 中国证监会

批准设立文号: 证监基金字【2004】80 号

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 壹亿元人民币

存续期间: 50 年

经营范围: 基金募集; 基金销售; 资产管理; 中国证监会许可的其他业务

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

存续期间: 持续经营

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。

(二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

1. 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，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对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。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：

- a. 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;
- b. 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;
- c. 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。

(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。

(3) 基金托管人在上述第(1)、(2)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定, 应及时通知基金管理人限期纠正, 基金管理人收到通知后应及时核对确认并改正。在限期内, 基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人应及时向中国证监会报告。

(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。

(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。

(6) 基金托管人对基金管理人监督的权利、义务及职责自合同生效之日起履行。

2. 基金管理人对基金托管人的业务核查

(1) 在本协议的有效期内, 在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上, 基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查, 核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户

和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

(三) 基金财产保管

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,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。

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. 基金的银行账户的开设和管理

(1)基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2)基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金

托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4)基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

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。

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或转让本基金的证券账户,亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

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

(4)在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,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。

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。

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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

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) 基金资产净值计算与复核

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业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个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四位内发生差错时,视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当报中国证监会备案;当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机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和基金托管人已承担的赔偿金额,则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7. 由于证券交易所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。

(五) 基金份额持有人名册的登记与保管

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。

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。

3. 基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册,基金管理人应及时向中国证监会报告,并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托

管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

(六) 适用法律与争议解决方式

1. 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

3. 除争议所涉的内容之外, 本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

(七) 托管协议的修改与终止

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。

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、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。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) 开户确认

基金管理人为投资者提供开户信息的短信确认及网上查询确认服务, 投资者可通过接收公司的开户确认短信或者登陆公司网站了解相关的开户信息。

(二) 资料发送

1. 基金投资者对账单

基金管理人为基金份额持有人提供季度对账单寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息, 基金管理人同时为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过公司网站、客服

电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息,我们将按投资者的选择定期为其发送电子对账单。

2. 其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别,寄送公司期刊及各类研究报告,动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

(三) 呼叫中心服务

东方呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询,在这个过程中客户有任何需要帮助的地方,均可以转接人工或在语音信箱中留言;系统同时受理E-Mail等多样化服务,为客户提供便捷多样的交流方式。

(四) 网上交易业务

本基金已开通网上交易业务,个人投资者可通过本公司网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务,本公司在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动,个人投资者通过本公司网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆本公司网站www.orient-fund.com或www.df5888.com查阅本公司旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

(五) 网上查询服务

通过本公司网站,客户还可获得如下服务:

1. 查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

2. 信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

(六) 短信服务

本公司已经开通短信服务,通过短信向投资者发送本公司基金、公司活动等内容的相关信息。

(七) 资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打本公司如下电话:

电话呼叫中心:010-66578578 或 400-628-5888,该电话可转人工座席。

传真:010-66578700

(八) 定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人,本基金自2009年6月30日起在齐鲁证券有限公司、7月23日起在工商银行股份有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司、2010年1月12日起在广发华福证券有限责任公司、7月7日起在安信证券股份有限公司、2011年5月17日起在中信证券股份有限公司等销售渠道开始办理定期定额投资业务(前端);通过本公司网上交易平台,于2009年7月8日起开通农行金穗卡、招行一卡通(借记卡),8月7日起开通民生银行借记卡、2010年5月21日起开通上海浦东发展银行卡和广东发展银行卡、2011年11月11日起开通中国建设银行卡等定期定额投资业务(前端),未来在各项技术条件和准备完备的情况下,将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

(九) 基金转换

为方便基金份额持有人,本公司已在直销中心、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司等开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

(十) 客户投诉受理服务

投资者可以通过客户服务热线(010-66578578)(400-628-5888)、公司网站(www.orient-fund.com)(www.df5888.com)、电子邮件(services@orient-fund.com)、传真(010-66578700)、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见,并按照“客户投诉和建议”流程处理,在规定的时间内予以反馈。

(十一) 投资顾问服务

本公司拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队,分布于北京、上海等地区,致力于为客户提供优异的个性化理财服务。

公司网址:<http://www.orient-fund.com> 或 <http://www.df5888.com>

电子信箱: services@orient-fund.com

二十一、其他应披露事项

(一) 在本基金存续期内, 本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化, 职能也会相应地做出调整, 但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

(二) 基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定(包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充)。上述规则由本基金管理人制定, 并由其解释与修改, 但规则的修改若实质性地修改了本基金合同, 应召开基金份额持有人大会, 对基金合同的修改达成决议。

(三) 本《招募说明书》将按中国证监会有关规定定期进行更新; 《招募说明书》解释与基金合同不一致时, 以基金合同为准。

(四) 从上次《招募说明书(更新)》截止日2011年6月24日至本次《招募说明书(更新)》截止日2011年12月24日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
本公司关于旗下基金继续参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-29
本公司关于旗下基金继续参与中信银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-30
本公司旗下基金净值公告	2011-7-1
本公司住所变更公告	2011-7-14
本基金2011年第2季度报告	2011-7-19
本基金招募说明书更新摘要(2011年第1号)	2011-8-15
本基金招募说明书更新(2011年第1号)	2011-8-5
本基金2011年半年度报告(摘要)	2011-8-27
本基金2011年半年度报告(正文)	2011-8-27
本公司关于增加五矿证券为旗下基金代销渠道的公告	2011-9-5
本公司关于旗下基金参与五矿证券网上交易基金申购费率优惠活动的公告	2011-9-27
本公司关于股权变更等相关事项的公告	2011-10-13
本公司关于开通短信服务的通知	2011-10-14
本基金2011年第3季度报告	2011-10-26
本公司关于网上交易平台开通中国建设银行卡定期定额投资业务的公告	2011-11-11
本公司关于增加恒泰长财证券为旗下基金代销渠道的公告	2011-11-17
本公司关于增加东莞证券为旗下基金代销渠道的公告	2011-11-23
本公司关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务的公告	2011-11-28

本公司变更高管人员的公告	2011-12-1
本公司变更高管人员的公告	2011-12-17

二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的办公地址,供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十三、备查文件

- (一) 中国证监会批准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的文件
- (二) 《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》
- (三) 《东方核心动力股票型开放式证券投资基金托管协议》
- (四) 《东方核心动力股票型开放式证券投资基金法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

东方基金管理有限责任公司

2012年2月6日