

# 国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

## 招募说明书（更新）

### 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2010年2月21日证监许可【2010】228号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。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，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，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，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年4月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日(财务数据未经审计)。

**基金管理人：国联安基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

## 目 录

第一部分 绪言 .....	3
第二部分 释义 .....	4
第三部分 基金管理人.....	9
第四部分 基金托管人.....	17
第五部分 相关服务机构.....	21
第六部分 基金份额分级.....	36
第七部分 基金的募集.....	38
第八部分 基金合同的生效.....	39
第九部分 双禧 100 份额的申购与赎回.....	40
第十部分 双禧 A 份额与双禧 B 份额的上市交易 .....	50
第十一部分 基金份额的系统内转托管、跨系统转登记等其他相关业务.....	51
第十二部分 基金的份额配对转换.....	53
第十三部分 基金的投资.....	56
第十四部分 基金的业绩.....	65
第十五部分 基金的财产.....	66
第十六部分 基金资产估值.....	67
第十七部分 基金的收益与分配.....	73
第十八部分 基金费用与税收.....	74
第十九部分 基金份额折算.....	77
第二十部分 双禧 A 份额与双禧 B 份额的终止运作 .....	80
第二十一部分 基金的会计与审计.....	81
第二十二部分 基金的信息披露.....	82
第二十三部分 风险揭示.....	86
第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	89
第二十五部分 基金合同摘要.....	92
第二十六部分 托管协议摘要.....	107
第二十七部分 对基金份额持有人的服务.....	118
第二十八部分 其他应披露的事项.....	121
第二十九部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	124
第三十部分 备查文件.....	125

---

## 第一部分 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》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规的规定，以及《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

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

---

## 第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1.基金或本基金：指国联安双禧中证100指数分级证券投资基金
- 2.基金管理人：指国联安基金管理有限公司
- 3.基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4.基金合同或本基金合同：指《国联安双禧中证100指数分级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
- 5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国联安双禧中证100指数分级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
- 6.招募说明书：指《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7.基金份额发售公告：指《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金份额发售公告》
- 8.上市交易公告书：指《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金之A份额与B份额上市交易公告书》
- 9.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10.《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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做出的修订
- 11.《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12.《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13.《运作办法》：指中国证监会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做出的修订
- 14.中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15.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
- 16.上市交易所：指深圳证券交易所
- 17.中证100指数：指由上海和深圳证券市场中选取100只A股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。中证100指数由中证指数有限公司编制并发布
- 18.基金份额分级：指本基金的基金份额包括国联安双禧中证100指数证券投资基金之基础份额、国联安双禧中证100指数证券投资基金之A份额与国联安双禧中证100指数证券

---

投资基金之B份额。其中，国联安双禧中证100指数证券投资基金之A份额与国联安双禧中证100指数证券投资基金之B份额的基金份额配比始终保持4：6的比率不变

19.双禧100份额：指国联安双禧中证100指数证券投资基金之基础份额

20.双禧A份额：指获取稳健收益的基金份额，即国联安双禧中证100指数证券投资基金之A份额

21.双禧B份额：指获取进取收益的基金份额，即国联安双禧中证100指数证券投资基金之B份额

22.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

23.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

24.机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、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

25.合格境外机构投资者：指符合现实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

26.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

27.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

28.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

29.销售机构：指直销机构和代销机构

30.直销机构：指国联安基金管理有限公司

31.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

32.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

33.场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、双禧100份额的申购和赎回的场所

34.场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、双禧A份额与双禧B份额上市交易、双禧100份额的申购和赎回的场所

35.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

---

36.注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为国联安基金管理有限公司或接受国联安基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

37.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

38.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

39.场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

40.场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

41.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

42.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的基金份额变动及结余情况的账户

43.基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

44.基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

45.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

46.存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限。

47.工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

48.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

49.T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

50.开放日：指为投资人办理双禧100基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

51.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

52.《业务规则》：指《国联安基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

53.认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

54.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通过场外或场内申请购买双禧100份额的行为

55.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通过场外或场内将双禧100份额兑换为现金的行为

56.份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的双禧100份额与双禧A份额、双禧B份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

---

57.分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每十份双禧100份额的场内份额申请转换成四份双禧A份额与六份双禧B份额的行为

58.合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每四份双禧A份额与六份双禧B份额进行配对申请转换成十份双禧100份额的场内份额的行为

59.基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的约定，对本基金所有份额进行折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为1.000元的行为

60.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

61.转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记

62.系统内转托管：指基金份额持有人将其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

63.跨系统转登记：指基金份额持有人将其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

64.定期定额投资计划：指投资人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人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

65.巨额赎回：指本基金单个开放日，双禧100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)超过上一开放日基金总份额（包括双禧100份额、双禧A份额、双禧B份额）的10%

66.上市交易：指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖双禧A份额、双禧B份额的行为

67.元：指人民币元

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

69.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

70.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71.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

72.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

73.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

---

74.不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法避免、无法克服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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：符学东

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2003】42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：（021）38992888

联系人：童鹭榕

股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

### 二、证券投资基金管理情况

截至2012年4月16日，本公司旗下共管理16只基金：国联安德盛稳健证券投资基金（以下简称“国联安稳健混合”）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安小盘精选混合”）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（以下简称“国联安安心成长混合”）、国联安德盛精选股票证券投资基金（以下简称“国联安精选股票”）、国联安德盛优势股票证券投资基金（以下简称“国联安优势股票”）、国联安德盛红利股票证券投资基金（以下简称“国联安红利股票”）、国联安德盛增利债券证券投资基金（以下简称“国联安增利债券”）、国联安主题驱动股票型证券投资基金（以下简称“国联安主题驱动股票”）、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金（以下简称“国联安双禧中证100指数分级”）、国联安信心增益债券型证券投资基金（以下简称“国联安信心增益债券”）、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“商品ETF”）、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基金（以下简称“国联安上证商品ETF联接”）、国联安货币市场证券投资基金（以下简称“国联安货币”）、国联安优选行业股票型证券投资基金（以下简称“国联安优选行业股票”）、国联安信心增长

---

定期开放债券型证券投资基金（以下简称“国联安定期开放债券”）和国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“国联安双力中小板综指分级”）。

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会成员

(1) 符学东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师，中共党员。历任国家体制改革委员会分配司副处长，国泰证券有限公司总裁助理，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现担任国联安基金管理有限公司董事长。

(2) Andrew Douglas Eu(余义焜)先生，副董事长，工商管理硕士。历任怡富证券投资有限公司高级研究分析员、投资经理、董事(地区业务)、JF资产管理有限公司董事、行政总裁。现任德盛安联资产管理亚太区行政总裁、董事、德盛安联资产管理香港有限公司董事、德盛安联资产管理公司董事、德盛安联资产管理日本公司董事、德盛安联资产管理卢森堡公司董事、香港证券及期货事务监察委员会咨询委员会委员。

(3) George Alan McKay先生，董事，英国牛津A类等级标准（经济学和英文）。历任英国Save & Prosper 管理有限公司(富林明集团)董事，怡富资产管理公司(香港) 营运董事、常务董事，摩根富林明资产管理公司(香港) 常务董事，纽约银行梅隆公司(原为梅隆国际投资管理公司)执行董事。现担任德盛安联资产管理亚太区首席营运官。

(4) 邵杰军先生，董事、总经理，研究生学历。1993年4月起任职于万国证券公司和申银万国证券股份有限公司；1998年6月加盟华安基金管理有限公司，担任常务副总裁，先后分管投资研究、市场营销、海外投资管理等多个业务领域。2011年11月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安基金管理有限公司董事、总经理。

(5) 汪卫杰先生，董事，经济学硕士，会计师职称。1994年起进入金融行业，历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现担任国泰君安证券股份有限公司监事会办公室主任、纪检监察室主任。

(6) 程静萍女士，独立董事，大专学历，高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理，上海市财政局、税务局副局长，上海市计划委员会、市物价局副主任兼局长，上海市发展计划委员会、发展改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海市创业投资行业协会会长、上海银行独立董事、上海市宏观经济学会专家委员会主任。

(7) 王丽女士，独立董事，法学博士。德恒律师事务所主任，首席全球合伙人，兼德恒海牙分所主任，德恒律师学院院长、教授，清华大学、北京大学研究生导师。中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，中国证券监督管理委员会重组委员会第一届、第二届委员，劳动部企业年金、全国社会保障基金理事会专家，全国工商业联合会执委、法律委员会委员。

---

(8) Thilo Ketterer先生，独立董事，经济管理博士，德国注册会计师，历任德国NEXIA国际集团审计助理，Carl Zeiss Semiconductor Manufacturing Technologies(SMT)AG会计主管，以色列Microspec Technologies Inc.董事，现任德国纽伦堡罗德会计师事务所（有限责任）合伙集团的合伙人和儒德管理咨询（上海）有限公司总经理。

## 2、监事会成员

(1) 蒋忆明先生，监事会主席，会计师，博士。历任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理、君安证券公司经纪业务部副总经理、资金计划部副总经理、总经理、君安证券公司财务总监、国泰君安证券股份有限公司深圳分公司副总经理、国泰君安证券股份有限公司总会计师。现任国泰君安证券股份有限公司财务总监。

(2) 庄小慧女士，监事，法律硕士。历任Bell, Temple见习律师、McCague, Peacock, Borlack, McInnis & Lloyd大律师及事务律师助理、金杜律师事务所事务律师助理、瑞士再保险公司法律顾问。现任德盛安联资产管理（亚太）有限公司法律顾问。

(3) 陆康芸女士，职工监事，法学硕士。历任中国工商银行上海市分行法律顾问、上海市海华永泰律师事务所律师，现担任本公司监察稽核部执行总监。

## 3、公司高级管理人员

(1) 符学东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师，中共党员。历任国家体制改革委员会分配司副处长，国泰证券有限公司总裁助理，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现担任国联安基金管理有限公司董事长。

(2) 邵杰军先生，董事、总经理，研究生学历。1993年4月起任职于万国证券公司和申银万国证券股份有限公司；1998年6月加盟华安基金管理有限公司，担任常务副总裁，先后分管投资研究、市场营销、海外投资管理等多个业务领域。2011年11月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安基金管理有限公司董事、总经理。

(3) 周浩先生，督察长，法学硕士。曾先后任职于中国证券监督管理委员会和上海航运产业基金管理有限公司；2012年2月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安基金管理有限公司督察长。

(4) 李柯女士，副总经理，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理，现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5) 王峰先生，经济学硕士。历任渤海证券研究所金融工程部研究员、天同证券研究所金融创新部主管、上海浦东发展银行股份有限公司基金托管部产品主管、上投摩根基金管理有限公司市场部总监、业务发展部总监、国联安基金管理有限公司总经理助理。

（注：自2012年4月20日起，王峰先生不再担任本公司副总经理。该公告于2012年4月21日披露。）

(6) 魏东先生，副总经理，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003年1月加盟华宝兴业基金管理有限公司，先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司，先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起，担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009年12月至2011年8月，兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。

#### 4、基金经理

##### (1) 现任基金经理：

黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士，于2002年11月加入兴业证券投资部任投资分析员。2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理，2010年5月起兼任国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010年12月起兼任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基金基金经理。

##### (2) 历任基金经理：

基金经理	担任本基金基金经理时间
冯天戈先生	2010年4月至2010年12月

#### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人(根据需要)组成。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 四、基金管理人的义务

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

2.办理基金备案手续；

3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

- 
- 5.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、双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧A份额与双禧B份额终止运作后的份额转换比例；
  - 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.按规定受理双禧100份额申购和赎回申请，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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 五、基金管理人的承诺

1.基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2.基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产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、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、基金管理人内部控制制度

基金管理人内部风险控制包括内部控制机制和内部控制制度两个方面。内部控制机制是指公司的内部组织结构及其相互之间的运行制约关系；内部控制制度是指公司为防范金融风险，保护资产的安全与完整，促进各项经营活动的有效实施而制定的各种业务操作程序、管理方法与控制措施的总称。

1、内部控制的目标

本基金管理人内部控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理公司。具体来说，必须达到以下目标：

(1) 严格遵守国家有关法律法规和行业监管规章，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

(2) 健全符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制。

---

(3) 建立行之有效的风险控制系统，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整。

(4) 不断提高经营管理的效率和效益，努力实现公司价值的最大化，圆满完成公司的经营目标和发展战略。

## 2、内部控制的原则

公司完善内部控制机制必须遵循以下原则：

(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，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、公司制订内部控制制度必须遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

## 4、内部控制的基本要求

(1) 公司必须依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

1) 建立以一线岗位为基础的第一道监控防线。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3) 建立以督察长、监察稽核部、风险管理部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长、风险管理部和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

---

(2) 公司必须建立科学的授权批准制度和岗位分离制度。各业务部门和分支机构必须在适当的授权基础上实行恰当的责任分离制度，直接的操作部门或经办人员和直接的管理部门或控制人员必须相互独立、相互牵制。

(3) 公司必须建立完善的岗位责任制度和规范的岗位管理措施。在明确不同岗位的工作任务基础上，赋予各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制度、严格的操作程序和合理的工作标准，大力推行各岗位、各部门、各机构的目标管理。

(4) 公司必须真实、全面地记载每一笔业务，充分发挥会计的核算和监督职能，健全会计、统计、业务等各种信息资料及时、准确报送制度，确保各种信息资料的真实与完整。

(5) 公司必须建立严密有效的风险管理系统，包括主要业务的风险评估和监测办法、分支机构和重要部门的风险考核指标体系以及管理人员的道德风险防范系统等。通过严密的风险管理，及时发现内部控制的弱点，以便堵塞漏洞、消除隐患。

(6) 公司必须制订切实有效的应急应变措施，设定具体的应急应变步骤。尤其是投资交易等重要部位遇到断电、失火等非常情况时，应急应变措施要及时到位，并按预定功能发挥作用，以确保公司的正常经营不会受到不必要的影响。

#### 5、内部风险控制的内容

公司内部风险控制的主要内容包括：投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、监察稽核控制等。

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(3) 公司根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。

(4) 公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(5) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的监察稽核控制制度，保证监察稽核部门的独立性和权威性。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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）67595003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，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 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收益率为 24.82%。利息净收入 2,230.10 亿元，较上年同期增长 22.41%。净利差为 2.56%，净利息收益率为 2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入 687.92 亿元，较上年同期增长 41.31%。

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、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 33

---

家，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、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

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。

## （二）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。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）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12月31日，中国建设银行已托管224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。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管

---

人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）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。

### （二）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。

### （三）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

### （一）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。

### （二）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。

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1. 场外销售机构

##### (1) 直销机构:

国联安基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大楼9楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大楼9楼

法定代表人: 符学东

电话: (021) 38992888

联系人: 茅斐

网址: [www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com) 或 [www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。

##### (2) 代销机构:

#### 1) 名称: 中国建设银行股份有限公司

办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人: 王洪章

联系人: 何奕

客户服务电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

#### 2) 名称: 华夏银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街22号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人: 吴建

联系人: 刘军祥

电话: (010) 85238423

传真: (010) 85238680

客户服务电话: 95577

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

#### 3) 名称: 中国工商银行股份有限公司

---

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66107900

传真：（010）66107914

联系人：何鹏

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

4) 名称：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：上海市银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏琪

开放式基金咨询电话：（021）38676161

传真：（021）38670666

客户服务电话：400-8888-666，95521

网址：www.gtja.com

5) 名称：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号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：（021）53594566

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553，400-8888-001

网址：www.htsec.com

6) 名称：申银万国证券股份有限公司

住所：上海市上海市常熟路171号

办公地址：上海市上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：（021）54033888

联系人：高夫

客户服务电话：（021）962505

---

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

7) 名称：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36、38、41、42楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

客户服务电话：(020) 87555888

传真：(020) 87555305

客户服务电话：95575

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

8) 名称：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2-6层

法定代表人：顾伟国

电话：(010) 66568047

联系人：田巍

客户服务电话：400-8888-888

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

9) 名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：(021) 68419974

客户服务电话：400-8888-123

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

10) 名称：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

联系人：蔡雪

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

11) 名称：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）82940764

联系人：吴少彬

客户服务电话：95565、400-8888-111

网址：www.newone.com.cn

12) 名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83195475

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

13) 名称：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5层

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马昭明

电话：（0755）82493561

联系人：庞晓芸

开放式基金咨询电话：400-8888-555，0755-25125666

开放式基金业务传真：（0755）82492962

客户服务电话：95513

网址：www.lhzq.com

---

14) 名称：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：田国立

电话：（010）65557013

联系人：李博

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

15) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

联系人：虞谷云

客服中心电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

16) 名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

咨询电话：（0755）82133066

传真：（0755）82133302

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

17) 名称：新时代证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街1号A座8层

办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501室

法定代表人：马金声

电话：（010）83561149

联系人：孙恺

---

客户服务电话：400-6989-898

网址：www.xsdzq.cn

18) 名称：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

电话：（010）88085338

联系人：李巍

客户服务电话：400-8000-562

网址：www.hysec.com

19) 名称：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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层

法定代表人：牛冠兴

电话：（0755）82558305

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008-001-001

网站：www.essence.com.cn

20) 名称：东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29楼

办公地址：上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29楼

法定代表人：潘鑫军

电话：（021）63325888-3108

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

21) 名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

---

电话：（021）63586189  
联系人：胡技勋  
客户服务电话：96528、962528（上海）  
网址：[www.nccb.com.cn](http://www.nccb.com.cn)

22) 名称：山西证券股份有限公司

住所：太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼  
办公地址：太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼  
法定代表人：侯巍  
电话：（0351）8686708  
联系人：孟婉婷  
客户服务电话：400-6661-618  
网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

23) 名称：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：北京市东城区朝阳门内大街188号  
法定代表人：张佑君  
电话：（010）85130577  
联系人：许梦圆  
客户服务电话：400-8888-108  
网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

24) 名称：爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号23楼  
地址：上海市南京西路758号博爱大厦20-25层  
法定代表人：郭林  
电话：（021）32229888  
联系人：陈敏  
客户服务电话：021-63340678  
网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

25) 名称：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）22169089

联系人：李芳芳

客户服务电话：400-8888-788

网址：www.ebscn.com

26) 名称：华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

法定代表人：陈林

联系电话：（021）50122222

联系人：宋歌

客户服务电话：400-8209-898

公司网址：www.cnhbstock.com

27) 名称：齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路20518号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系电话：（0531）81283906

联系人：王霖

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

28) 名称：银泰证券有限责任公司

住所：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

法定代表人：黄冰

联系电话：（0755）83704098

联系人：罗鸣捷

客户服务电话：（0755）83710885

网址：www.ytzq.net

---

29) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市福田区红荔西路301栋

办公地址：广东省深圳市福田区福华三路星河发展中心

法定代表人：孙健一

联系电话：（0755）22626198

联系人：蔡宇洲

客户服务电话：40066-99999

网址：bank.pingan.com

30) 名称：东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：（021）50586660-8644

联系人：霍晓飞

客户服务电话：400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

31) 名称：华福证券有限责任公司

住所：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：（0591）87383623

客户服务电话：（0591）96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

32) 名称：信达证券股份有限公司

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

联系电话：（010）88656100

联系人：唐静

客户服务电话：400-8008-899

网址：www.cindasc.com

33) 名称：中国银行股份有限公司

---

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

联系电话：（010）66592638

传真：（010）66594568

网址：www.boc.cn

34) 名称：国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人：冉云

联系电话：（028）86690021

联系人：金喆

传真：（028）86695681

网址：www.gjq.com.cn

35) 名称：东莞证券有限责任公司

住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：游锦辉

联系电话：（0769）22119426、（0769）22119351

传真：（0769）22119423

联系人：张建平、罗绍辉

网址：www.dgzq.com.cn

客户服务电话：（0769）961130

36) 名称：中信证券股份有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人：王东明

客户服务电话：95558

联系人：张于爱

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

37) 名称：中国中投证券有限责任公司

---

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层  
办公地址：深圳市福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层  
法定代表人：杨明辉  
联系人：刘毅  
客户服务电话：400-6008-008  
网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

38) 名称：华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市中山东路90号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
客户服务电话：95597  
电话：（025）84457777-235  
联系人：万鸣  
网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

39) 名称：平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层  
法定代表人：杨宇翔  
客户服务电话：400-8816-168，（0755）22627052  
联系人：周璐  
联系电话：（0755）22626172  
网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

40) 名称：中航证券有限公司

住所：江西省南昌市抚河北路291号  
法定代表人：杜航  
电话：（0791）6768681  
联系人：戴蕾  
客户服务电话：400-8866-567  
网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com)或 [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

41) 名称：东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街1138号  
法定代表人：矫正中

---

电话：（0431）85096530  
联系人：王京京  
客户服务电话：400-6000-686  
网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

- 42) 名称：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  
法定代表人：胡运钊  
客户服务电话：95579，400-8888-999  
联系人：李良  
电话：（027）65799999  
传真：（027）85481900  
客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)
- 43) 名称：华融证券股份有限公司  
住所：北京市西城区月坛北街26号  
办公地址：北京市西城区月坛北街26号恒华国际商务中心9层  
法定代表人：丁之锁  
电话：（010）58568118  
联系人：林长华  
网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)
- 44) 名称：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室  
法定代表人：林义相  
联系电话：（010）66045566  
联系人：林爽  
客户服务电话：010-66045678  
网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com) 或 [jijin.txsec.com](http://jijin.txsec.com)
- 45) 名称：西南证券股份有限公司  
住所：重庆市江北区桥北苑8号  
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号  
法定代表人：王宜四（代）

---

电话：（023）63786433

联系人：陈诚

网址：www.swsc.com.cn

46) 名称：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21层

法定代表人：张智河

电话：（0532）85022326

联系人：吴忠超

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

47) 名称：天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

电话：（027）87618889

联系人：翟璟

业务联系电话：（027）87618882

客户服务网站：www.tfzq.com

48) 名称：江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：（0451）82269280

联系人：张宇宏

网址：www.jhzq.com.cn

49) 名称：中信证券（浙江）有限责任公司

住所：杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20楼

办公地址：杭州市江南大道 558号恒鑫大厦19楼

法定代表人：沈强

---

电话：（0571）85783737  
联系人：丁思聪  
客户服务电话：96598  
网址： www.bigsun.com.cn

- 50) 名称：红塔证券股份有限公司  
住所：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼  
办公地址：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼  
法定代表人： 况雨林  
电话：（0871）3577942  
联系人： 钱叶兰  
客户服务电话：0871-3577930  
网址： www.hongtastock.com

## 2.场内销售机构

本基金的场内销售机构为基金管理人直销中心和具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体销售机构名单详见深圳证券交易所网站。

## 二、注册登记机构

中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层  
办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层  
法定代表人：金颖  
电话：（010）58598835  
传真：（010）58598907  
联系人：任瑞新

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：韩炯  
联系电话：（021）31358666  
传真：（021）31358600

---

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所

住所：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼

办公地址：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼

负责人：蔡廷基

联系电话：（021）53594666

传真：（021）62881889

联系人：黎俊文

经办注册会计师：王国蓓、陈彦君

## 第六部分 基金份额分级

本基金的基金份额分级及其基本运作如下。

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括“双禧100份额”、“双禧A份额”与“双禧B份额”。其中，双禧A份额、双禧B份额的基金份额配比始终保持4：6的比率不变。

### （二）基金的基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为双禧100份额；场内认购的全部份额将按4：6的比率确认为双禧A份额与双禧B份额。

2、本基金合同生效后，双禧100份额接受场外与场内申购和赎回；双禧A份额、双禧B份额只上市交易，不接受申购和赎回。

3、本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理双禧100份额与双禧A份额、双禧B份额之间的份额配对转换业务。

4、本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算。折算后基金运作方式及双禧A与双禧B份额配比不变。

#### （1）双禧100份额折算

基金份额折算日折算后，双禧100份额的基金份额净值折算调整为1.000元。折算后，双禧100份额持有人持有的双禧100份额的份额数按照双禧100折算比例相应增加或缩减。若折算前，双禧100份额净值大于1.000元，则折算后双禧100份额持有人持有的双禧100份额增加；若折算前，双禧100份额净值小于或等于1.000元，则折算后双禧100份额持有人持有的双禧100份额缩减。

#### （2）双禧A、双禧B份额折算

基金份额折算日折算后，双禧A、双禧B份额的基金份额净值折算调整为1.000元。根据双禧B折算日折算前的基金份额净值，按以下两种情况进行基金份额的折算：

##### 1) 折算日折算前双禧B的基金份额净值大于1元

如果双禧B份额折算日折算前基金份额净值大于1.000元，则持有人持有的双禧A份额及双禧B份额的数量在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成双禧100份额的场内份额。

##### 2) 折算日折算前双禧B的基金份额净值小于或等于1元

如果双禧B份额折算日折算前的基金份额净值小于或等于1.000元，则双禧B份额持有人持有的双禧B份额数按照双禧B份额的折算比例相应缩减。为保持双禧A和双禧B份额比

---

例4：6不变，双禧A份额的折算比例与双禧B份额的折算比例相同，双禧A份额持有人持有的双禧A份额数同比例相应缩减，超出份额数将全部折算成双禧100份额的场内份额。

### （三）双禧A份额、双禧B份额概要

#### 1、存续期限

自基金合同生效之日起存续

#### 2、基金份额配比

双禧A份额与双禧B份额的基金份额配比始终保持4：6的比率不变。

#### 3、双禧A份额与双禧B份额的份额净值计算

##### （1）双禧A、双禧B、双禧100份额净值关系

本基金四份双禧A份额与六份双禧B份额构成一对份额组合，一对份额组合的净值之和将等于十份双禧100份额的净值。

##### （2）双禧A份额的基金份额净值计算

双禧A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率加上3.5%。其中计算双禧A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

双禧A份额的约定年收益率除以365得到双禧A份额的约定日简单收益率。双禧A份额的基金份额净值以基金合同生效日或折算日的1元净值为基准采用双禧A份额的约定日简单收益率单利进行计算。

##### （3）双禧B份额的份额净值计算

计算出双禧A的份额净值后，根据双禧100、双禧A、双禧B份额净值的关系，可以计算出双禧B的份额净值。

##### （4）双禧A份额与双禧B份额的份额净值公告

双禧A和双禧B份额净值在当天收市后计算，并在下一日内与本基金份额净值一同公告。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。

#### 4、双禧A份额与双禧B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，双禧A份额与双禧B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

---

## 第七部分 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》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，经2010年2月21日中国证监会证监许可【2010】228号文件核准募集。募集期为2010年3月18日至2010年4月9日。经毕马威华振会计师事务所验资，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间共募集982,138,906.44份基金份额，有效认购总户数为8043户。

---

## 第八部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同已于2010年4月16日生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 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。

中国证监会另有规定的，按其规定办理。

---

## 第九部分 双禧 100 份额的申购与赎回

本基金的双禧 A 份额、双禧 B 份额将不接受投资者的申购与赎回。投资者可通过场外或场内两种方式对双禧 100 份额进行申购与赎回。

### 一、申购和赎回场所

双禧 100 份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。双禧 100 份额场内申购与赎回的场所为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。

本基金具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行双禧 100 份额的申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理双禧 100 份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停双禧 100 份额申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

申购开始日：2010 年 6 月 18 日

赎回开始日：2010 年 6 月 18 日

代理销售网点在开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间及代理销售网点规定的具体时间。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。

直销网点在开放日的具体业务办理时间为上午 9:30-下午 3:00。

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双禧 100 基金份额的申购、赎回等业务。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回等业务申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的双禧 100 份额的净值为基准进行计算；

---

2. “金额申购、份额赎回”原则，即双禧 100 份额的申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行双禧 100 份额的赎回；

4. 当日双禧 100 份额的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### **四、申购与赎回的程序**

##### **1. 申购和赎回的申请方式**

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出双禧 100 份额的申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的双禧 100 基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### **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受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购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，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### **五、申购和赎回的数额限制**

1. 双禧 100 份额场外申购的首次单笔申购最低金额为人民币 1,000 元(含申购费)，追加申购的单笔申购最低金额为人民币 1,000 元(含申购费)。

2. 双禧 100 份额场内申购的单笔申购最低金额为人民币 1,000 元(含申购费)。

3. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### **六、申购和赎回的价格、费用及其用途**

## 1. 双禧 100 份额的申购费率、申购份额的计算及处理方式

### (1) 申购费率

双禧 100 份额的场外申购费率具体如下：

申购金额 (M)	申购费率
100 万以下	1.20%
100 万 (含) 至 500 万	0.70%
500 万 (含) 至 1000 万	0.20%
1000 万元 (含) 以上	每笔交易 1000 元

投资者通过“国联安·易购”基金网上直销平台申购本基金可享受前端申购费率优惠。具体优惠申购费率以最新的相关公告为准。

基金管理人并不设置申购金额上限，但各银行卡具体的申购上限要遵守各银行网上银行上限标准。本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求，并依据相关法规的要求提前进行公告。

双禧 100 份额并适时参加相关代销机构申购费率优惠活动，具体活动细则及费率情况详情参见基金管理人有关公告。该等申购费率优惠活动最终解释权归相关代销机构所有，活动具体规定如有变化，敬请基金投资人留意相关代销机构的有关公告。

双禧 100 份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

### (2) 计算方法：

双禧 100 份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式为：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日双禧 100 份额的基金份额净值}$$

举例：

例 3：某投资者通过场外投资 10,000 元申购双禧 100 份额，申购费率为 1.2%，假定申购当日双禧 100 份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,881.42 / 1.050 = 9,410.88 \text{ 份}$$

例 4：如例 3，如果该投资者选择通过场内申购，假定申购费率也为 1.2%，则因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,410 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者。计算方法如下：

$$\text{实际净申购金额} = 9,410 \times 1.050 = 9,880.50 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,880.50 - 118.58 = 0.92 \text{ 元}$$

### (3) 处理方式：

通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，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者资金账户。

## 2. 双禧 100 份额的赎回费率、赎回金额的计算及处理方式

### (1) 赎回费率：

双禧 100 份额的场外赎回费率具体如下：

持有时间	赎回费率
持有 1 年以下	0.50%
持有 1 年（含）至 2 年	0.25%
持有 2 年（含）及以上	0.00%

注：其中 1 年按 365 天计算，2 年按 730 天计算。

双禧 100 份额的场内赎回费率固定为 0.50%。

### (2) 计算方法：

双禧 100 份额赎回金额的计算采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日双禧 100 份额的基金份额净值为基准进行计算，计算公式为：

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日双禧 100 份额的基金份额净值

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

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

举例：

例 5：某投资者赎回 10,000 份双禧 100 份额，持有时间为 8 个月，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日双禧 100 份额的基金份额净值是 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 = 10,000 × 1.050 = 10,500.00 元

赎回费用 = 10,500.00 × 0.5% = 52.50 元

净赎回金额 = 10,500.00 - 52.50 = 10,447.50 元

3. 双禧 100 份额的基金份额净值计算：双禧 100 份额的份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 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。

4. 双禧 100 份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

5. 双禧 100 份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付基金管理人其他相关费用。

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

7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

### 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对双禧 100 份额的申购申请：

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。

### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的双禧 100 份额的赎回申请或延缓支付赎回款项：

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。在双禧 100 份额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。

## 九、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双禧 100 份额的净赎回申请(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(包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 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。

(3) 暂停赎回：双禧 100 份额连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受双禧 100 份额的赎回申请；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。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

## 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登双禧 100 份额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双禧 100 份额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双禧 100 份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的双禧 100 份额净值。

## 十一、基金转换

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双禧 100 份额与基金管理人管理的、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。

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

### （一）适用的基金范围

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金及本公司旗下管理的国联安双力中小板综指分级证券投资基金（基金简称：国联安双力中小板综指，场内简称：国安双力；基金代码：162510）。

本公司今后发行的其他开放式基金的基金转换业务另行公告。

### （二）基金转换费及转换份额的计算

#### 1、转换费

进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。

（1）转换手续费率为零。如基金转换手续费率调整将另行公告。

（2）目前，国联安双力中小板综指分级证券投资基金场外赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
持有期<1 年	0.5%
1 年≤持有期<2 年	0.25%
持有期≥2 年	0%

上述赎回费率可能根据本公司公告而进行调整，届时以最新公布的费率为准。

(3) 转入基金与转出基金的申购补差费按转入基金与转出基金之间申购费率的差额计算收取，具体计算公式如下：

转入基金与转出基金的申购补差费率 =  $\max [ (\text{转入基金的申购费率} - \text{转出基金的申购费率}), 0 ]$ ，即转入基金申购费率减去转出基金申购费率，如为负数则取零。

目前，国联安双力中小板综指分级证券投资基金场外申购费率如下：

申购金额（含申购费）	费率
100 万以下	1.20%
100 万（含）至 500 万	0.70%
500 万（含）至 1000 万	0.20%
1000 万（含）及以上	每笔交易 1,000 元

前端份额之间转换的申购补差费率按转出金额对应转入基金的申购费率和转出基金的申购费率作为依据来计算。后端份额之间转换的申购补差费率为零，因此申购补差费为零。

2、转换份额的计算公式：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

转换费用 = 转换手续费 + 转出基金的赎回费 + 申购补差费

其中：

转换手续费 = 0

赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

申购补差费 =  $(\text{转出金额} - \text{赎回费}) \times \text{申购补差费率} / (1 + \text{申购补差费率})$

(1) 如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费 + 申购补差费

(2) 如果转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费

(3) 转入金额 = 转出金额 - 转换费用

(4) 转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额作为确定依据。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

3、基金转换业务举例：

例：某投资者通过场外投资 101,200 元申购国联安双禧中证 100 指数分级份额，申购费率为 1.2%，申购申请当日国联安双禧中证 100 指数分级份额的基金份额净值是 1.0000 元，则可申购场外国联安双禧中证 100 指数分级份额 100,000 份。持有一年半后，该投资者将这 100,000 份场外国联安双禧中证 100 指数分级份额转换为场外国联安双力中小板综

---

指分级份额，转换申请当日国联安双力中小板综指分级份额净值为 1.0000 元，国联安双禧中证 100 指数分级份额的基金份额净值为 1.0500 元。则：

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值=100,000×1.0500= 105,000 元；

赎回费=转出金额×转出基金赎回费率=105,000×0.25%=262.5 元；

申购补差费=0 元；

转换费用=赎回费+申购补差费=262.5 元；

转入金额=转出金额-转换费用=105,000-262.5=104,737.5 元；

转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值=104,737.5/1.0000=104,737.50 份。

### （三）转换业务规则

1、基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时，转出的基金必须处于可赎回状态，转入的基金必须处于可申购状态。

2、基金转换采取未知价法，即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

3、正常情况下，基金注册登记机构将在 T+1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者可在相关网点查询基金转换的成交情况。

4、目前，每次对上述单只基金转换业务的申请不得低于 1000 份基金份额；且如因某笔基金转出业务导致该基金单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，基金管理人将该交易账户保留的基金份额余额一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

5、单个开放日单只基金净赎回申请（赎回申请份额与转出申请份额总数，扣除申购申请份额与转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日该基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先等级，基金管理人可根据该基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

6、目前，原持有基金为前端收费模式下基金份额的，只能转换为其他前端收费模式的基金份额，后端收费模式下的基金份额只能转换为其他后端收费模式的基金份额。

7、目前，原持有的基金为场外份额的，只能转换为其他场外基金份额。原持有的基金为场内份额的，由于目前场内尚未开通基金转换业务，若持有场内基金份额的投资者欲办理转换业务，投资者须先通过跨系统转登记的方式将场内基金份额转为场外基金份额，然后再进行基金的转换。

---

8、通过基金管理人网上直销系统办理前端收费模式下本基金管理人旗下部分基金的转换业务，享有费率优惠，有关详情敬请参见相关公告或咨询本基金管理人客户服务中心。

上述业务规则具体以本基金注册登记机构的相关规定为准。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内根据实际情况调整转换业务规则并公告。

#### （四）适用销售机构

本基金在以下销售机构办理转换业务：国联安基金管理有限公司网上交易系统、国联安基金管理有限公司直销柜台、中国建设银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中航证券有限公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、中国银行股份有限公司、齐鲁证券有限公司和中信银行股份有限公司。

本基金管理人可根据情况变更或增减上述销售机构，并另行公告。

#### （五）重要提示

1、基金发行期内不受理基金转入交易申请，该基金成立并开放申购赎回业务后受理基金转换业务。新基金的转换规定，以本公司公告为准。

2、本招募说明书仅对国联安双禧中证 100 指数分级基金和国联安双力中小板综指分级基金的转换事项予以说明。

3、本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制，但最迟应在调整生效前按照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4、本基金转换业务的解释权归本公司。

## 十二、双禧 100 份额定期定额投资计划

参见本招募说明书第二十七部分“对基金份额持有人的服务”之第（二）项“定期定额投资计划”。

## 第十部分 双禧 A 份额与双禧 B 份额的上市交易

本基金的双禧 A 份额（基金简称“双禧 A”，交易代码 150012）与双禧 B 份额（基金简称“双禧 B”，交易代码 150013），经深圳证券交易所深证上【2010】193 号文批准，自 2010 年 6 月 18 日起在深圳证券交易所上市交易。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

经基金托管人中国建设银行股份有限公司复核，双禧 A 截止 2010 年 6 月 17 日的基金份额净值为 1.010 元，上市首日以该基金份额净值 1.010 元（四舍五入至 0.001 元）为开盘参考价，并以此为基准设置涨跌幅限制，幅度为 10%；双禧 B 截止 2010 年 6 月 17 日的基金份额净值为 0.955 元，上市首日以该基金份额净值 0.955 元（四舍五入至 0.001 元）为开盘参考价，并以此为基准设置涨跌幅限制，幅度为 10%。

### 一、上市交易的行情揭示及基金资产净值的披露

双禧 A 份额、双禧 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。每个工作日的次日公布该工作日的双禧 100、双禧 A 与双禧 B 的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

### 二、未上市交易份额的流通规定

未上市交易的双禧 100 份额办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，可以向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，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成双禧 A 和双禧 B，分拆后的双禧 A 和双禧 B 可以在深圳证券交易所场内上市流通。

### 三、上市交易的费用

双禧 A 份额、双禧 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### 四、上市交易的停复牌与暂停、终止上市

双禧 A 份额、双禧 B 份额的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

五、双禧 A 份额、双禧 B 份额上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

六、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金的基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

---

## 第十一部分 基金份额的系统内转托管、跨系统转登记等其他相关业务

### 一、基金份额的登记

1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；双禧 A 份额、双禧 B 份额，以及场内申购买的份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的双禧 100 份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的双禧 100 份额可申请场外赎回。

3、登记在证券登记结算系统中的双禧 A 份额、双禧 B 份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

### 二、系统内转托管

1、系统内转托管是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。

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双禧 100 份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有双禧 100 份额的系统内转托管。

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双禧 A 份额、双禧 B 份额上市交易或双禧 100 份额场内赎回业务的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理系统内转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理系统内转托管时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

### 三、跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的双禧 100 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、双禧 100 份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3、投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转登记业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转登记时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

4、根据基金管理人于 2010 年 6 月 10 日发布的《国联安基金管理有限公司关于开通国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之基础份额跨系统转托管业务的公告》，自 2010 年 6 月 18 日起，基金管理人开通双禧 100 份额的跨系统转托管业务。

---

场外认/申购双禧 100 份额的投资者自 2010 年 6 月 18 日起可以通过认/申购双禧 100 份额的场外代销机构或本基金管理人直销机构办理跨系统转托管业务，将基金份额转至深圳证券交易所场内，跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。场外认/申购的双禧 100 份额只有在办理跨系统转托管业务并通过分拆转换为国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 A 份额（简称“双禧 A”）和国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 B 份额（简称“双禧 B”），才可将双禧 A 或双禧 B 在深圳证券交易所进行交易。

持有场内双禧 100 份额的投资者自 2010 年 6 月 18 日起可以通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位办理跨系统转托管业务，将基金份额转至场外代销机构或本基金管理人直销机构，跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。场内持有双禧 A 与双禧 B 的投资者只有通过合并转换为双禧 100 份额，才可申请办理跨系统转托管业务。

#### **四、基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻**

本基金的非交易过户、质押、冻结与解冻等，按照中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所等相关机构的规定办理。

## 第十二部分 基金的份额配对转换

根据基金管理人于 2010 年 6 月 10 日发布的《国联安基金管理有限公司关于国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金开通份额配对转换的公告》，基金管理人自 2010 年 6 月 18 日起，开通本基金的份额配对转换业务。

**一、份额配对转换是指本基金的双禧 100 份额与双禧 A 份额、双禧 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。**

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每十份双禧 100 份额的场内份额申请转换成四份双禧 A 份额与六份双禧 B 份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每四份双禧 A 份额与六份双禧 B 份额进行配对申请转换成十份双禧 100 份额的场内份额的行为。

### 二、份额配对转换业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

### 三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），业务办理时间为上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00。在此时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

### 四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行“分拆”的双禧 100 份额的场内份额必须是 10 的整数倍。

3、申请进行“合并”的双禧 A 份额与双禧 B 份额必须同时配对申请，且双禧 A 份额和双禧 B 份额必须为正整数且两者的比例为 4：6。

4、双禧 100 份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转登记为双禧 100 份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记结算机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

### 五、份额配对转换业务办理规则

---

1、投资者以中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 A 股账户或证券投资基金账户（以下简称“深市证券账户”）申报份额配对转换业务中的“分拆”或“合并”指令，申报前需备足对价，即投资者提出“合并”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的双禧 A 与双禧 B 基金份额；投资者提出“分拆”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的双禧 100 基金份额。

2、投资者通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，统一以双禧 100 的交易代码“162509”作为申请指令的证券代码，以份额为单位进行“合并”或“分拆”申报。

3、“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是 10 份的整数倍，并且，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于 1000 份。

基金管理人可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报的最低份额数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告。

4、办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资者每笔“分拆”或“合并”申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行预冻结。

5、在交易时间内，份额配对转换业务办理机构通过深证通 FDEP 消息传输系统将份额配对转换申报指令发送给中国证券登记结算有限责任公司的基金业务系统。正常情况下，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司在 T 日收市后对投资者 T 日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认，并进行份额变更处理，办理转出基金份额的扣除以及转入基金份额的登记。自 T+1 日起（包括该日）投资者可查询基金份额配对转换的成交情况。

6、投资者 T 日提出的 M 份份额“分拆”申请被确认成功后，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司将在投资者所申报的深市证券账户上扣减 M 份双禧 100，同时增加  $4M/10$  份双禧 A 与  $6M/10$  份双禧 B。正常情况下，自 T+1 日（含该日）起新增的双禧 A 与双禧 B 基金份额可进行交易。

7、投资者 T 日提出的 N 份份额“合并”申请被确认成功后，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司将在投资者所申报的深市证券账户上扣减  $4N/10$  份双禧 A 和  $6N/10$  份双禧 B，同时增加 N 份双禧 100。正常情况下，自 T+1 日（含该日）起新增的双禧 100 基金份额可进行赎回等交易。

8、双禧 100 的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为双禧 100 的场内份额后方可进行。

9、投资者提出的份额配对转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

10、份额配对转换应遵循届时发布的相关业务规则。

运作期内场内份额配对转换程序遵循深圳证券交易所、基金登记结算机构的最新业务规则。深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人可视情况对上述规

---

定作出调整，基金管理人将按规定在至少一家中国证监会指定媒体和基金管理人网站公告。

## **六、暂停份额配对转换的情形**

1、当双禧 A 份额与双禧 B 份额的保有份额总额接近或高于 100 亿份时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的“分拆”申请。

2、深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述第一项且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的“分拆”申请或发生前述第二项或第三项的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

## **七、份额配对转换的业务办理费用**

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可按照不高于 0.3% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

目前投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。相关业务规则如有变更，基金管理人将另行公告。

---

## 第十三部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。

### 二、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股、备选成份股、新股、现金和到期日在一年以内的政府债券等。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

基金管理人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上述相关规定。

### 三、投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现了对中证 100 指数的有效跟踪。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

#### 1、股票组合的构建方法

本基金按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建股票投资组合。如有股票停牌的限制、股票流动性、法律法规限制等因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成分股等）进行适当替代。

## 2、股票指数化投资日常投资组合管理

### (1) 组合调整原则

本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与标的指数间的跟踪误差最小化。

### (2) 投资组合调整方法

本基金将对标的指数进行定期与不定期跟踪调整,同时也会结合限制性调整措施对基金资产进行适当调整。

### (3) 跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。

## 四、业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证 100 指数。

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股,以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。中证 100 指数具有市场代表性好、历史业绩表现突出、编制规则透明度高、成份股数目适合跟踪、流动性强、市场认知程度高、指数运作体系完备、未来创新潜力较大等综合优势。

如果中证 100 指数被停止编制及发布,或中证 100 指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致中证 100 指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上出现其他代表性更强、更合适投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益的前提下,更换本基金的标的指数和投资对象;并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象,需履行适当程序,并在正式实施前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

### 2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:  $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率 (税后)}$ 。

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股票指数时,本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

---

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

## 五、风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

## 六、投资决策流程

### 1、投资依据

- (1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定；
- (2)经济运行态势和证券市场走势。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

### 3、投资程序

- (1)首先运用数量化模型以及各种风险监控指标,结合公司内外的研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析,提出研究分析报告。
- (2)投资决策委员会依据相关研究分析报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。
- (3)基金经理根据标的指数,结合研究分析报告,原则上依据指数成份股的权重构建资产组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的技术和方法,降低交易成本,控制投资风险。
- (4)交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。
- (5)根据市场变化,定期和不定期评估基金投资绩效。风险管理部对基金投资计划的执行进行日常监督和风险控制。
- (6)基金经理密切跟踪标的指数的变动,结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、绩效评估报告等,对投资组合进行监控和调整,以实现跟踪误差的有效控制。
- (7)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。

## 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) 本基金投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

(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) 本基金持有的同一权证不超过该权证的10%；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%；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%；

(4) 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%；

(5) 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；

(6) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(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；

(9)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和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

本基金可以根据届时有效的法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## 十、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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——中国建设银行根据本基金合同规定，于2012年5月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2012年3月31日，本报告财务资料未经审计师审计。

### (一) 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	3,017,722,207.18	93.23
	其中：股票	3,017,722,207.18	93.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	181,478,043.89	5.61
6	其他各项资产	37,505,914.30	1.16
7	合计	3,236,706,165.37	100.00

## (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1. 指数投资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	5,016,161.15	0.16
B	采掘业	367,720,356.97	11.54
C	制造业	810,575,830.08	25.45
C0	食品、饮料	220,827,492.69	6.93
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	32,733,534.92	1.03
C5	电子	8,100,986.40	0.25
C6	金属、非金属	195,984,174.49	6.15
C7	机械、设备、仪表	328,126,822.40	10.30
C8	医药、生物制品	24,802,819.18	0.78
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	64,378,565.80	2.02
E	建筑业	78,849,234.11	2.48

F	交通运输、仓储业	91,593,445.07	2.88
G	信息技术业	64,835,866.68	2.04
H	批发和零售贸易	38,915,672.25	1.22
I	金融、保险业	1,336,502,339.42	41.96
J	房地产业	140,693,393.15	4.42
K	社会服务业	18,641,342.50	0.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,017,722,207.18	94.74

## 2. 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### (三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 1. 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	11,758,345	139,924,305.50	4.39
2	600016	民生银行	21,477,153	134,661,749.31	4.23
3	601318	中国平安	3,185,767	116,535,356.86	3.66
4	601328	交通银行	21,770,744	102,540,204.24	3.22
5	601166	兴业银行	7,179,286	95,628,089.52	3.00
6	600000	浦发银行	10,641,852	95,031,738.36	2.98
7	601088	中国神华	3,136,066	80,314,650.26	2.52
8	600519	贵州茅台	394,857	77,771,034.72	2.44
9	000002	万科A	9,204,364	76,212,133.92	2.39
10	600030	中信证券	6,548,436	75,896,373.24	2.38

#### 2. 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

**(五) 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**

本基金本报告期末未持有债券。

**(六) 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。

**(七) 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。

**(八) 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出现被监管部门立案调查，或在本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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	36,714,994.08
3	应收股利	-
4	应收利息	38,644.44
5	应收申购款	2,275.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,505,914.30

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资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。

---

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

## 第十四部分 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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	基金份额净值 增长率①	同期业绩比 较基准收益 率③	①-③	净值增 长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	②-④
2010-04-16 至 2010-12-31	7.20%	-11.55%	18.75%	1.33%	1.60%	-0.27%
2011-01-01 至 2011-12-31	-20.15%	-19.85%	-0.30%	1.20%	1.20%	0.00%
2012-01-01 至 2012-03-31	4.56%	4.99%	-0.43%	1.32%	1.32%	0.00%
2010-04-16 至 2012-03-31	-10.50%	-25.57%	15.07%	1.26%	1.37%	-0.11%

---

## 第十五部分 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。

---

## 第十六部分 基金资产估值

### 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，按照基金管理人对于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、基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值。

#### 1、双禧100份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

双禧100份额的基金份额净值计算公式为：

$$T\text{日双禧100份额的基金份额净值} = T\text{日闭市后的基金资产净值} / T\text{日本基金（包括双禧100份额、双禧A份额、双禧B份额）的基金份额余额总数}$$

例6：假设T日闭市后，本基金的基金资产净值为55亿元，双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额余额分别为12亿份、16亿份与24亿份，则双禧100份额的基金份额净值计算如下：

$$T\text{日双禧100份额的基金份额净值} = 55 / (12 + 16 + 24) = 1.058\text{元}$$

#### 2、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算

(1) 本基金四份双禧A份额与六份双禧B份额构成一对份额组合，一对双禧A份额与双禧B份额的份额组合的净值之和将等于十份双禧100份额的净值。

(2) 双禧A份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率加上3.5%。其中计算双禧A份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

双禧A份额的约定年收益率除以365得到双禧A份额的约定日简单收益率。双禧A的份额净值以基金合同生效日或折算日1元净值为基准采用双禧A份额的约定日简单收益率单利进行计算。

(3) 计算出双禧A份额的份额净值后，根据双禧A、双禧B和双禧100份额净值的关系，计算出双禧B的份额净值。

(4) 如果根据上述计算规则计算出来的双禧B的份额净值小于或等于0.150元，则基金管理人将根据基金合同约定，对本基金所有份额进行折算，折算后所有的基金份额净值调整到1.000元。

(5) 双禧A、双禧B折算日折算后份额净值都调整为1.000元，折算后双禧A、双禧B的份额净值计算方法保持不变。

(6) 双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算公式

假设上一折算日后第 $t$ 个自然日，双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值分别为 $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ ，上一折算日次日的一年期银行定存年利率为 $R$ 。则第 $t$ 个自然日，双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算如下：

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 3.5\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_t) / 0.6$$

例7：假设上一折算日后第100个自然日，双禧100份额净值 $NAV_t$ 分别为1.200、0.950、0.496，上一折算日次日的一年期银行定存年利率为2.25%。

(1) 当 $NAV_t = 1.200$ 时

根据基金份额净值计算规则，双禧A和双禧B的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

$$NAV(B)_t = (1.200 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 1.323$$

(2) 当 $NAV_t = 0.950$ 时

根据基金份额净值计算规则，双禧A和双禧B的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

$$NAV(B)_t = (0.950 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 0.906$$

(3) 当 $NAV_t = 0.496$ 时

根据基金份额净值计算规则，双禧A和双禧B的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

$$NAV(B)_t = (0.496 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 0.149$$

---

由于双禧B份额净值小于0.150元，则基金管理人将根据基金合同约定，自该日起三个工作日内对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到1.000元。

## 五、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0.001元，小数点后第四位四舍五入。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。

## 六、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3位以内(含第3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)差错的各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它原则处理差错。

### 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) 本基金任一类份额的错误偏差达到份额净值的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；本基金任一类份额的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。

## 七、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，决定延迟估值；
- 4.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、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。

## 九、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。

---

## 第十七部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、收益分配原则

本基金（包括双禧100份额、双禧A份额、双禧B份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止双禧A份额与双禧B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

---

## 第十八部分 基金费用与税收

### 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.基金上市费及年费；
- 9.标的指数许可使用费；
- 10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

(一) 与基金运作有关的费用：

#### 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1%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0.22%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.基金合同生效后的指数许可使用费

指数许可使用费是指数许可使用基点费，指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；基金合同生效当年，不足3个月的，按照3个月收费。指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年。

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，基金管理人应于每年1月，4月，7月，10月的最后一个工作日前，按照双方确认的金额向中证指数有限公司支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用基点费的下限，则该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人承担。

4.除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，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。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见“第九部分 双禧100份额的申购与赎回”的内容。

### 2、赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见“第九部分 双禧100份额的申购与赎回”的内容。

## 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。

---

## 第十九部分 基金份额折算

### 一、基金份额折算日

自上一基金份额折算日次日或基金合同生效日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日双禧B的份额净值都大于0.150元，则最后工作日为基金份额折算日；如果期间某个工作日（T日）双禧B的份额净值小于或等于0.150元，则该日后的第二个工作日（T+2日）为基金份额折算日。

如，假设本基金成立于2010年3月17日，则基金运作满三年的对应日为2013年3月16日（周六），基金运作满三年的最后工作日为2013年3月15日（周五），如果2010年3月17日至2013年3月15日期间，双禧B的份额净值都大于0.150元，则基金份额第一个折算日为2013年3月15日。

基金份额第一个折算日的次日为2013年3月16日，运作满三年的对应日为2016年3月15日（周二），基金运作满三年的最后工作日为2016年3月15日（周二），如果2013年3月16日至2016年3月15日期间的2015年11月27日（周五）双禧B的份额净值小于或等于0.150元，则基金份额第二个折算日为2015年11月27日后的第二个工作日，即2015年12月1日。

基金份额第二个折算日的次日为2015年12月2日，运作满三年的对应日为2018年12月1日（周六），基金运作满三年的最后工作日为2018年11月30日（周五），如果2015年12月2日至2018年11月30日期间双禧B的份额净值都大于0.150元，则基金份额第三个折算日为2018年11月30日。

基金份额其他折算日的计算以此类推。

折算后基金运作方式及双禧A与双禧B份额配比不变。

### 二、基金份额折算类别

根据基金份额折算日的触发条件不同，基金份额折算日分为基金份额到期折算日和基金份额到点折算日，基金份额折算也相应地分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

#### 1、基金份额到期折算

自上一基金份额折算日次日或基金合同生效日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日双禧B的份额净值都大于0.150元，则最后工作日为到期折算日。在到期折算日实施的基金份额折算为基金份额到期折算。

#### 2、基金份额到点折算

自上一基金份额折算日次日或基金合同生效日始至满三年的最后工作日止，如果期间某个工作日双禧B的份额净值小于或等于0.150元，则该日后的三个工作日内某工作日为到点折算日，具体的基金份额到点折算日见基金管理人届时发布的公告。在到点折算日实施的基金份额折算为基金份额到点折算。

### 三、基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的本基金所有份额。

#### 四、基金份额折算方法

基金份额到期折算和基金份额到点折算的折算方法一致，均按以下方法在基金份额折算日对所有基金份额进行折算：

##### 1、双禧100份额折算

基金份额折算日折算后，双禧100份额的基金份额净值折算调整为1.000元。折算后，双禧100份额持有人持有的双禧100份额的份额数按照双禧100份额折算比例相应增加或缩减。若折算前，双禧100份额净值大于1.000元，则折算后双禧100份额持有人持有的双禧100份额增加；若折算前，双禧100份额净值小于或等于1.000元，则折算后双禧100份额持有人持有的双禧100份额缩减。

双禧100份额的折算比例=折算日折算前双禧100份额的基金份额净值 / 1

双禧100份额经折算后的份额数=折算前双禧100份额的份额数×双禧100份额的折算比例

双禧100份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；双禧100份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

##### 2、双禧A、双禧B份额折算

基金份额折算日折算后，双禧A、双禧B份额的基金份额净值折算调整为1.000元。根据双禧B折算日折算前的份额净值，按照以下两种情况进行基金份额的折算：

###### (1) 折算日折算前双禧B的份额净值大于1元

如果双禧B份额折算日折算前份额净值大于1.000元，则持有人持有的双禧A份额及双禧B份额的数量在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成双禧100份额的场内份额。

双禧A份额（或双禧B份额）的折算比例=折算日折算前双禧A份额（或双禧B份额）的基金份额净值 / 1

双禧A份额（或双禧B份额）新增份额折算成双禧100份额的场内份额=折算前双禧A份额（或双禧B份额）的份额数×[双禧A份额（或双禧B份额）的折算比例-1]

折算后双禧A份额（或双禧B份额）的份额数=双禧A份额（或双禧B份额）折算前的份额数

双禧A份额（或双禧B份额）折算成双禧100份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

###### (2) 折算日折算前双禧B的份额净值小于或等于1元

如果双禧B份额折算日折算前的基金份额净值小于或等于1.000元，则双禧B份额持有人持有的双禧B份额数按照双禧B份额的折算比例相应缩减。为保持双禧A和双禧B份额数

---

比率4: 6不变, 双禧A份额的折算比例与双禧B份额的折算比例相同, 双禧A份额持有人持有的双禧A份额数同比例相应缩减, 超出份额数将全部折算成双禧100份额的场内份额。

双禧B份额的折算比例=折算日折算前双禧B份额的基金份额净值 / 1

双禧B份额经折算后的份额数=折算前双禧B份额的份额数×双禧B份额的折算比例

双禧A份额的折算比例=折算日折算前双禧B份额的基金份额净值/1

双禧A份额经折算后的份额数=折算前双禧A份额的份额数×双禧A份额的折算比例

双禧A份额超出份额折算成双禧100份额的场内份额=折算前双禧A份额的份额数×(折算日折算前双禧A份额的基金份额净值-折算日折算前双禧B份额的基金份额净值)

双禧A和双禧B份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份), 余额计入基金财产。双禧A份额折算成双禧100份额的场内份额取整计算(最小单位为1份), 余额计入基金财产。

### 3、折算后双禧100份额的总份额数

折算后双禧100份额的总份额数=双禧100份额经折算后的份额数+双禧A份额折算成双禧100份额的场内份额+双禧B份额折算成双禧100份额的场内份额

## 五、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停双禧A份额与双禧B份额的上市交易和双禧100份额的申购或赎回等业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 六、基金份额折算的公告

1、在基金份额实施到期折算前, 基金管理人将在至少一家指定媒体和基金管理人网站, 就实施到期折算的有关事项进行提示性公告。

2、本基金运作期间, 如双禧B份额净值在某一开放日高于0.250元, 但在下一开放日不高于0.250元的, 基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3、本基金运作期间, 如双禧B份额净值在某一开放日小于或等于0.150元, 则该日后的两个工作日内, 基金管理人将就基金份额实施到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4、基金份额到期或到点折算结束后, 基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果的具体内容。

## 第二十部分 双禧 A 份额与双禧 B 份额的终止运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，双禧A份额与双禧B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自的基金份额持有人或其代理人所持双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

### 二、双禧A份额与双禧B份额终止运作后的份额转换

双禧A份额与双禧B份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，双禧A份额、双禧B份额将全部转换成双禧100份额的场内份额。

#### 1、份额转换基准日

双禧A份额与双禧B份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

#### 2、份额转换方式

在转换基准日日终，以双禧100份额的基金份额净值为基准，双禧A份额、双禧B份额按照各自的基金份额净值转换成双禧100份额的场内份额。双禧A份额（或双禧B份额）基金份额持有人持有的转换后双禧100份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

双禧A份额（或双禧B份额）的转换比率=份额转换基准日双禧A份额（或双禧B份额）的基金份额净值/份额转换基准日双禧100份额的基金份额净值

双禧A份额（或双禧B份额）基金份额持有人持有的转换后双禧100份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前双禧A份额（或双禧B份额）的份额数×双禧A份额（或双禧B份额）的转换比率

#### 3、份额转换后的基金运作

双禧A份额与双禧B份额全部转换为双禧100份额的场内份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

#### 4、份额转换的公告

双禧A份额与双禧B份额进行份额转换结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

---

## 第二十一部分 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；
- 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)同意后，并报中国证监会备案可以更换。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。

## 第二十二部分 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》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书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、基金份额上市交易公告书

双禧A份额和双禧B份额获准在证券交易所上市交易，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### 六、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双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值；

2.在双禧A份额、双禧B份额上市交易或者开始办理双禧100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，披露开放日双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自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双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值。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、以及双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自的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。

#### 七、双禧100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双禧100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。

#### 八、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。

#### 九、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.某一类份额的净值计价错误达该类基金份额净值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.双禧100份额开始办理申购、赎回；
- 22.双禧100份额申购、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.本基金暂停接受双禧100份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26.本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；
- 27.本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28.本基金实施基金份额折算；

---

29.双禧A份额与双禧B份额终止运作；

30. 双禧A份额与双禧B份额终止运作后双禧A份额、双禧B份额的份额转换；

31. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### 十、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。

#### 十一、基金份额持有人大会决议

#### 十二、中国证监会规定的其他信息

#### 十三、信息披露文件的存放与查阅

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印件或复印件。

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，以及双禧A份额与双禧B份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。本基金的上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人和双禧A份额与双禧B份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。

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。

## 第二十三部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的风险

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

#### （一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

#### （三）流动性风险

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者的申购和赎回。由于开放式基金在国内发展历史不长，应对基金赎回的经验不足，加之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，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

#### （四）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

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

#### （五）本基金的特定风险

1、指数投资风险。本基金为股票型指数基金，投资标的为中证100指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

##### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### （2）标的指数跟踪误差风险

因标的指数成份股调整、增发、配股、分红等，或者因新股认购、基金现金资产拖累、基金交易成本和交易冲击以及基金费用的提取等原因，基金的收益水平相对于标的指数回报率可能出现偏离，从而导致出现跟踪误差风险。

##### （3）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

2、基金运作的特有风险 双禧A份额与双禧B份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金，投资者投资于本基金还将面临以下特有风险。

##### （1）基金份额的风险收益特征

本基金的双禧100份额为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

双禧A份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。

双禧B份额表现出高风险、高收益的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。为避免双禧B的份额净值跌到零，本基金采取了基金份额到点折算机制，但是如果市场出现极端下跌，双禧B的份额净值依旧存在跌到零的风险。

##### （2）基金的收益分配

本基金（包括双禧100份额、双禧A份额、双禧B份额）将不进行收益分配。

根据基金合同的约定，在基金份额折算日，基金管理人将对双禧A和双禧B份额实施基金份额折算。双禧A份额（或双禧B份额）的投资者可通过赎回双禧A（或双禧B）的新增

---

双禧100场内份额的方式获取投资回报，但是，该获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额赎回的价格波动风险。

### （3）份额配对转换业务中存在的风险

本基金《基金合同》生效后，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理双禧100份额与双禧A份额、双禧B份额之间的份额配对转换业务。一方面，这一业务的办理可能改变双禧A份额与双禧B份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，这一业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

### （4）流动性风险

在双禧A份额与双禧B份额上市交易后，双禧A份额与双禧B份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资者不能迅速、低成本地变现或买入的风险。

在基金份额折算期间，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停双禧A份额与双禧B份额的上市交易和双禧100份额的申购或赎回等业务，投资者的基金份额可能面临不能变现的风险。

### （5）份额转换的风险

根据基金合同的规定，实施基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，双禧A份额、双禧B份额的新增份额将全部折算成双禧100份额的场内份额；终止双禧A份额与双禧B份额的运作后，双禧A份额、双禧B份额将全部转换成双禧100份额的场内份额。在双禧A份额、双禧B份额的份额转为双禧100份额的场内份额后，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险和会员单位不具备基金场内赎回业务资格而导致不能直接赎回双禧100份额的场内份额的风险。

### （6）基金份额的折/溢价交易风险

双禧A份额与双禧B份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。对于双禧A份额、双禧B份额，尽管在基金份额配对转换机制下，四份双禧A份额与六份双禧B份额的市价总和将与十份双禧100份额的净值之间具有逼近的趋势，但是，双禧A份额或双禧B份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于基金份额配对转换套利机制的影响，双禧A份额与双禧B份额的交易价格可能会相互影响，尤其是在临近份额配对转换业务的办理时点的时候。

## 二、声明

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

---

## 第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

1.以下基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- (1)转换基金运作方式；
- (2)变更基金类别；
- (3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定除外）；
- (4)变更基金份额持有人大会程序；
- (5)更换基金管理人、基金托管人；
- (6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- (7)本基金与其他基金的合并；
- (8)终止双禧 A 份额与双禧 B 份额的运作；
- (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。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- (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双禧 100 份额的申购费率、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重大变化；
- (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.关于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，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

### 二、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。

### 三、基金财产的清算

#### 1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，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；
- (11)基金财产清算期限为六个月。

#### 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) 根据基金合同终止日双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自净值分别计算双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 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。

---

## 第二十五部分 基金合同摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### （一）基金管理人的权利和义务

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，拒绝或暂停受理双禧 100 份额申购和赎回申请；

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，并依据基金销售服务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、审计师、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、双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后的份额转换比例和双禧 100 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. 按规定受理双禧 100 份额申购和赎回申请，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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利和义务

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. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
3. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
4. 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；
5. 依法召集基金份额持有人大会；
6. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
7. 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、双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后的份额转换比例和双禧 100 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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。。

### （三）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. 依法转让其持有的双禧 A 份额与双禧 B 份额，依法申请赎回其持有的双禧 100 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。

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。

## 二、基金份额持有人大会

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### (二)召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1)终止基金合同；

- 
- (2)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)终止双禧A份额与双禧B份额的运作;
  - (10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - (11)单独或合计持有双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金总份额10%以上(含10%,下同)基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - (12)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
  - (13)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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双禧100份额的申购费率、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重大变化;
- (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。

### (三)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. 单独或合计代表双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金份额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，单独或合计代表双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金份额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. 单独或合计代表双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金份额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，单独或合计代表双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金份额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。

#### (四)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；
- (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。

#### (五)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)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的50%（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双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额占权益登记日各自基金总份额的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。

#### (六)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双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金总份额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;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。

(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双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金总份额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前30日及时公告。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，则由出席大会的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自基金份额持有人和代理人以所持表决权的50%以上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。

### (七)决议形成的条件、表决方式、程序

1. 双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

### 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，一般决议须经参加大会的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额持有人或其代理人各自所持双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额表决权的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，特别决议应当经参加大会的双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额持有人或其代理人各自所持双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止双禧A份额与双禧B份额的运作、终止基金合同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。

#### (八)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、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。

(九)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。

(十)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

(一)基金合同的变更

1.以下基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定除外）；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)终止双禧A份额与双禧B份额的运作；

(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。

---

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- (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双禧100份额的申购费率、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重大变化；
- (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.关于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，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## (二)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。

## (三)基金财产的清算

### 1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，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；
- (11)基金财产清算期限为六个月。

### 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) 根据基金合同终止日双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自净值分别计算双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的双禧A份额与双禧B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 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。

基金合同受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、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。

---

## 第二十六部分 托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：国联安基金管理有限公司

注册地址：上海市世纪大道88号金茂大厦46楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

邮政编码：200121

法定代表人：符学东

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2003]42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务。

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：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

---

(一) 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。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数的成份股、备选成份股、新股、现金和到期日在一年以内的政府债券等。其中,投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二) 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) 本基金投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(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) 本基金持有的同一权证不超过该权证的10%;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%;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%;

(4) 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%;

(5) 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;

(6) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的15%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的5%;

(7) 法律法规及中国证监会规定的其它限制。

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。

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。

(三) 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。

（四）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及损失，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。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，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。

1. 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其

---

他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- (1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- (2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- (3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- (4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6.相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 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、双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算、基金份额折算比例计算、双禧A份额与双禧B份额终止运作后的份额转换比例计算、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。

(七) 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。

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

(九) 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。

(十) 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

(一) 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、双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧A份额与双禧B份额终止运作后的份额转换比例，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。

(二) 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。

(三) 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

##### (一) 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。

##### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

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

2.基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《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。

### （三）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。

### （四）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。

### （五）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。

### （六）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。

#### （七）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。

#### （八）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

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1. 双禧100份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

双禧100份额的基金份额净值计算公式为：

$$T日双禧100份额的基金份额净值 = T日闭市后的基金资产净值 / T日本基金（包括双禧100份额、双禧A份额、双禧B份额）的基金份额余额总数$$

例：假设T日闭市后，本基金的基金资产净值为55亿元，双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额余额分别为12亿份、16亿份与24亿份，则双禧100份额的基金份额净值计算如下：

$$T日双禧100份额的基金份额净值 = 55 / (12 + 16 + 24) = 1.058元$$

##### 2. 双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算

1) 本基金四份双禧A份额与六份双禧B份额构成一对份额组合，一对双禧A份额与双禧B份额的份额组合的净值之和将等于十份双禧100份额的净值。

2) 双禧A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率加上3.5%。其中计算双禧A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

双禧A份额的约定年收益率除以365得到双禧A份额的约定日简单收益率。双禧A的份额净值以基金合同生效日或折算日1元净值为基准采用双禧A份额的约定日简单收益率单利进行计算。

3) 计算出双禧A份额的份额净值后, 根据双禧A、双禧B和双禧100份额净值的关系, 计算出双禧B的份额净值。

4) 如果根据上述计算规则计算出来的双禧B的份额净值小于或等于0.150元, 则基金管理人将根据基金合同的约定, 对本基金所有份额进行折算, 所有的基金份额净值调整到1.000元。

5) 双禧A、双禧B折算日折算后份额净值都调整为1元, 折算后双禧A、双禧B的份额净值计算方法保持不变。

6) 双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算公式

假设上一折算日后第 $t$ 个自然日, 双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值分别为 $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ , 上一折算日次日的一年期银行定存年利率为 $R$ 。

则第 $t$ 个自然日, 双禧A份额与双禧B份额的基金份额净值计算如下:

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 3.5\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_t) / 0.6$$

例: 假设上一折算日后第100个自然日, 双禧100份额净值 $NAV_t$ 分别为1.200、0.950、0.496, 上一折算日次日的一年期银行定存年利率为2.25%。

(i) 当 $NAV_t = 1.200$ 时

根据基金份额净值计算规则, 双禧A和双禧B的份额净值为:

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

$$NAV(B)_t = (1.200 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 1.323$$

(ii) 当 $NAV_t = 0.950$ 时

根据基金份额净值计算规则, 双禧A和双禧B的份额净值为:

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

$$NAV(B)_t = (0.950 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 0.906$$

(iii) 当 $NAV_t = 0.496$ 时

根据基金份额净值计算规则, 双禧A和双禧B的份额净值为:

$$NAV(A)_t = 1 + (2.25\% + 3.5\%) \times 100 / 365 = 1.016$$

---

$$NAV(B)_t = (0.496 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 0.149$$

由于双禧B份额净值小于0.150元，则基金管理人将根据基金合同约定，自该日起三个工作日内对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到1.000元。

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。

### 3.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将双禧100份额、双禧A份额与双禧B份额的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。

4.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登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、双禧A份额与双禧B份额上市交易的前一日、双禧A份额与双禧B份额终止运作日、基金份额折算日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额名称与基金份额。

本基金的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金份额持有人名册由基金的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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

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

### （一）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。

### （二）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。

---

## 第二十七部分 对基金份额持有人的服务

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

### （一）邮寄服务

#### 1. 定期对账单邮寄服务

基金管理人设立客户服务中心。每季度结束后 20 个工作日内，客户服务中心将向该季度发生过交易的基金份额持有人邮寄该持有人最近一季度基金账户状况对账单。年度结束后的 20 个工作日内，客户服务中心向所有在册有基金份额的持有人及第四季度发生过交易的投资者寄送最近一季度基金帐户状况对帐单。

#### 2. 其它相关的信息资料

指不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料等。

### （二）定期定额投资计划

基金管理人已正式推出双禧 100 份额的“定期定额投资计划”，投资人可通过本公司指定的基金销售机构提交申请，约定每月扣款时间和扣款金额（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），由销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请。

目前已开通基金定期定额投资计划的销售机构为：国联安基金管理有限公司网上直销业务平台（限规定的银行卡，具体以相关公告为准）、华夏银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、华融证券有限公司、中信银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司和江海证券有限公司。

投资者通过国联安网上交易平台定期定额申购本基金可享受前端定期定额申购费率优惠，具体优惠申购费率以相关公告为准。本基金并适时参加相关代销机构定期定额申购费率优惠活动，具体活动细则及费率情况详情参见基金管理人有关公告。

基金管理人为满足广大投资人的理财需求，将增加或变更定期定额业务的代理销售渠道，代理销售网点名称以公告为准。

### （三）客户服务中心

---

## 1.客服中心电话服务

### 1) 自动语音服务

呼叫中心自动语音查询系统提供 7×24 小时自动语音服务和查询服务，客户可通过电话查询基金份额净值、基金账户余额等信息。

### 2) 人工服务

客服中心提供每周 5 个工作日的人工服务。

客服中心电话：021-38784766、400-7000-365(免长途话费)

## 2.网上客户服务

网上客户服务为投资者提供查询服务、资讯服务以及相互交流的平台。投资者可以查询热点问题，并对服务进行投诉和建议。

网址：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com) 或 [www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)

客服电子邮箱：[customer.service@gtja-allianz.com](mailto:customer.service@gtja-allianz.com)

## 3.电子邮件服务

投资者可以在网站上订阅邮件公共信息服务，内容包括基金份额净值、基金资讯信息、定期基金报告和临时公告等。

## (四)网上交易

基金管理人已开通工行卡、农行卡、建行卡、招行卡、民生卡、浦发卡、中信卡、兴业卡、光大卡和平安卡的基金网上直销业务，持有上述借记卡的基金投资人满足相关条件下，可以直接通过基金管理人网站（[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)，[www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)）办理开户手续，并通过基金管理人网上直销系统办理双禧 100 份额的申购、赎回和定投等业务。通过基金管理人网上直销系统办理双禧 100 份额申购业务的基金投资人可享受前端申购费率优惠。持有工行卡、农行卡、招行卡、浦发卡、民生卡、光大卡或平安卡的基金投资人还可以直接通过基金管理人网上直销系统办理定期定额投资业务并享受前端收费模式下定期定额申购费率优惠。有关详情可参见相关公告。

在条件成熟的时候，基金管理人将根据基金网上交易业务的发展状况，适时扩大可用于基金网上交易平台或用于交易支付的银行卡种类，敬请基金投资人留意相关公告。

基金网上交易业务的解释权归本公司所有。

## (五) 客户投诉受理服务

投资者可以通过电话(021-38784766、400-7000-365)、邮件（[customer.service@gtja-](mailto:customer.service@gtja-)

---

allianz.com)、网上留言、书信等主要投诉受理渠道对基金管理人的工作提出投诉和建议，客户服务人员会及时地进行处理。

## 第二十八部分 其他应披露的事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

1、经中国证监会批准后，基金管理人将申请本基金在证券交易所上市交易，具体规定请参见基金管理人公告。

2、自合同生效以来，本基金管理人涉及托管业务无诉讼、仲裁事项。

3、最近3年本基金管理人在本期内未受到任何处分。

4、基金披露的其他重要事项

披露日期	公告名称	披露媒体
2011-10-22	国联安基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-10-26	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-10-28	国联安基金管理有限公司关于调整网上直销基金定期定额申购金额限制的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-10-31	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-11-19	国联安基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-11-29	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书更新	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》

2011-12-07	国联安基金管理有限公司关于中信万通证券有限责任公司开通我司旗下部分基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2011-12-31	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-01-04	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2012 倾心回馈”基金定投前端申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-01-07	国联安基金管理有限公司关于基金网上直销业务新增通联支付支持银行卡并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-01-19	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-02-13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-02-20	国联安基金管理有限公司关于国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金增加红塔证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-03-03	国联安基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-03-24	国联安基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》

2012-03-29	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2011 年年度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-06	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-07	国联安基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-09	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-12	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金开放日常转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-13	国联安基金管理有限公司关于中国银行股份有限公司开通国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金的转换业务公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-16	国联安基金管理有限公司关于齐鲁证券有限公司开通国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金的转换业务公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》
2012-04-16	国联安基金管理有限公司关于中信银行股份有限公司开通国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金的转换业务公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》

---

## 第二十九部分 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和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

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。

---

## 第三十部分 备查文件

- (一) 中国证监会核准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金募集的文件
- (二) 《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 《国联安基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (八) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所,基金投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

国联安基金管理有限公司

二〇一二年五月三十日