

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金 招募说明书（更新）

2012年第2号

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会 2010 年 11 月 24 日证监许可【2010】1694 号文核准募集。

基金管理人保证《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,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:因整体政治、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,本基金的特定风险,等等。投资者在进行投资决策前,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。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 9 月 15 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 6 月 30 日,财务数据未经审计。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

目 录

一、绪 言.....	1
二、释 义.....	2
三、风险揭示.....	6
四、基金管理人.....	9
五、 境外投资顾问.....	15
六、 基金的募集.....	16
七、 基金合同生效.....	16
八、 基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管.....	16
九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	23
十、基金的投资.....	25
十一、基金的业绩.....	40
十二、基金的费用与税收.....	41
十三、基金财产.....	43
十四、基金资产估值.....	44
十五、基金收益与分配.....	46
十六、基金的会计与审计.....	47
十七、基金的信息披露.....	48
十八、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	51
十九、基金托管人.....	53
二十、境外托管人.....	56
二十一、相关服务机构.....	59
二十二、基金合同的内容摘要.....	71
二十三、基金托管协议内容摘要.....	97
二十四、对基金份额持有人的服务.....	106
二十五、其他应披露事项.....	109
二十六、招募说明书存放及查阅方式.....	110
二十七、备查文件.....	110

一、 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)、其他有关规定及《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本基金是根据本招募说明书所载明资料申请募集的。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,或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写,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,并依照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释 义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金
- 2、基金管理人：指华宝兴业基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、境外投资顾问：指 Lyxor Asset Management S.A.（领先资产管理公司）
- 5、境外基金托管人：指中国银行（香港）有限公司
- 6、基金合同：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 7、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝兴业成熟市场动量优选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
- 8、招募说明书或本招募说明书：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 9、基金份额发售公告：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金份额发售公告》
- 10、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
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 12、《试行办法》：指中国证监会 2007 年 6 月 21 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、外管局：指国家外汇管理局或其授权的代表机构
- 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、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
- 17、个人投资者：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人
- 18、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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、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

20、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

21、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

22、销售机构：指直销机构和代销机构

23、直销机构：指华宝兴业基金管理有限公司

24、代销机构：指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

25、基金销售网点：指直销机构的直销柜台及代销机构的代销网点

26、基金网上交易系统：指直销机构的直销 e 网金及代销机构的网上交易系统

27、登记结算业务：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

28、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。基金的登记结算机构为华宝兴业基金管理有限公司或接受华宝兴业基金管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构

29、基金账户：指登记结算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

30、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

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：上海证券交易所、深圳证券交易所以及纽约、伦敦、东京、法兰克福、香港、悉尼证券交易所同时正常交易的交易日；但是，本合同涉及信息披露和备案等类似条款所指的工作日，是指除中国法定节假日之外的日期

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、T日：指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的工作日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

39、D日：本基金暂停申购或赎回后重新开放该业务的开放日

40、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

41、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

42、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、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

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

46、元：指人民币元

47、基金收益：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

48、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

49、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

50、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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金基金份额的行为

53、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

54、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

55、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、风险揭示

(一) 投资于本基金的风险

本基金特有风险：

1、金融模型风险：模型风险指由于市场环境的变化、模型使用不当等，导致金融模型在某些情况下可能出现有效性降低甚至无效的状况。对于本基金来说，出现这种情况的原因主要包括以下几个方面：

(1) 历史数据的使用：资产的波动率及各类资产的相关性数据主要通过历史数据取得，当特定资产的基本面发生重大变化时，资产波动率及相关性数据可能与现实出现一定程度的偏差进而影响模型结果的精确性和有效性。

(2) 模型参数估计错误：本基金模型中的部分参数需要基金管理人根据主观判断进行估计，在这种情况下可能出现基金管理人参数估计错误，从而导致模型有效性降低甚至失效的情况。

(3) 模型操作不当：可能存在基金管理人使用模型时数据录入出错，模型运用不当等操作型风险，进而影响模型的有效性。

2、动量策略的风险：本基金采用以动量策略为主的多因素量化投资模型来进行基金资产在不同类别以及地区之间的配置。动量策略在市场出现快速上涨或下跌的过程中可能存在一定的反应时滞，影响策略的有效性。同时，在市场出现频繁的波动时，动量策略的有效性可能受到较大影响。

另外，本基金采用合成期权的方法来捕捉市场动量，因此运作过程中可能存在实际组合与合成期权的之间有对冲误差的风险，这种误差的大小将主要由相关资产的波动率以及合成期权的 Gamma 值决定。

3、基金中基金的风险：对于基金中基金而言，还存在着标的基金基金管理人自身经营管理不善，而出现标的基金的投资以及运作等风险，严重时甚至导致标的基金的清盘，进而影响本基金的整体收益。

4、集中度风险

本基金为全球资产配置型基金，在部分市场条件下可能出现基金资产相对集中在股票类资产或债券类资产上的情况。此时基金资产对这类资产的风险暴露度会显著增加，出现集中度风险。

QDII 基金的共同风险：

5、海外市场风险：由于本基金投资于海外证券市场，因此各国或地区处于不同产业景气循环周期，也将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场可能由于对于负面的特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反映较境内证券市场有诸多不同。并且，这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带

来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

6、政府管制风险：因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，产生风险。

7、政治风险：政治风险指因所投资地政治不稳定而蒙受损失的风险，这可以由政权更迭、政策及法规的改变所造成。

8、流动性风险：本基金面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险；证券投资中个券的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现都有可能因流动性问题而增加变现成本，对本基金的资产净值造成不利影响。这种风险在发生大额赎回时表现尤为突出。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本基金在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

另外，本基金投资于海外，这就使得投资人的资金调度较为不便。基金的赎回净值是以赎回申请日为准，但真正赎回时的转换汇率却是以汇入投资人帐户当日为准。由于期间差异为7-14天，因此对赎回的投资人而言，不到最后资金汇入其帐户，很难确知具体的金额，增加了投资人理财规划的不便。

9、汇率风险：本基金以人民币为计价单位，但所投资的资产及来自该等资产的收入将会或可能会以其他货币为单位，因此本基金的资产会受持有资产的货币与人民币之间的汇率走势所影响。本基金的投资表现也可能受外汇管制规定变更的影响。

10、操作风险：指在本基金在交易和结算中，由于内部控制系统不完善或缺乏必要的后台技术支持而导致的风险。具体包括两类：一是由于内部监管体系不完善、经营管理上出现漏洞、工作流程不合理等带来的风险；二是由于各种偶发性事故或自然灾害，如电脑系统故障、通讯系统瘫痪、地震、火灾、工作人员差错等给基金交易者造成损失的可能性。决定营运风险的形成及大小的主要因素包括管理漏洞和内部控制失当、交易员操作不当以及会计处理偏差等。

11、会计核算风险：会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险，通常是指基金会计在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失。

12、交易结算风险：结算风险是一种特殊形式的信用风险。当双方在同一天进行交换时，就会产生结算风险。在一方已经进行了支付后，如果另一方发生违约，就会产生结算风险。

13、法律风险：指由于本基金交易合约的条款在法律上有缺陷或缺失法律的支持等原因可能导致的风险。

14、信用风险：信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速地改变债券的价格，从而影响到基金资产。

15、利率风险：利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险是债券投资所面临的主要风险，息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平。利率的波动仅间接影响到股市。

16、大宗交易风险：大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

17、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

18、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而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- (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；

(二) 声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

四、基金管理人

(一) 基金管理人概况

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

总经理：裴长江

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

电话：021-38505888

联系人：韩东霞

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东法国领先资产管理有限公司持有 49% 的股份。

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

(1) 董事会成员

郑安国先生，董事长、博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理、总裁。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

Alain Jean Patrick DUBOIS 先生，董事，硕士。曾任法国财政部预算办公室部门负责人、里昂信贷资本市场部从事研究开发工作、拉扎德兄弟银行部门经理、Arjil et Cie 银行董事总经理、德国商业银行资深产品设计师、法国兴业银行资深产品设计师、领先资产管理有限公司业务发展部负责人。现任领先资产管理有限公司董事长。

裴长江先生，董事，硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理，申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理，申银万国证券股份有限公司经纪总部副

总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

谢文杰先生，董事，金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区（除日本外）董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

张群先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任北京科技大学金属材料系讲师、北京科技大学管理科学系讲师。现任北京科技大学经济管理学院教授、院长。

罗飞先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士，独立董事，法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

（2）监事会成员

张永光（Jackson CHEUNG）先生，监事，工商管理硕士。曾在法国兴业银行主管银团贷款、项目融资、固定收益、外汇交易、衍生产品及结构性融资等工作，法国兴业银行亚洲区债务融资及衍生产品业务部总管。现任法国兴业银行集团中国区总裁。

贾璐女士，监事，硕士研究生，高级工程师。曾任宝钢自动化部组干科主办，宝钢国贸公司人事部人才开发室主任，宝钢国际公司人力资源部部长、组织部部长，宝钢资源（国际）公司总经理助理。现任华宝投资公司副总经理，宝钢集团金融系统党委副书记。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任公司营运副总监。

（3）总经理及其他高级管理人员

裴长江先生，总经理，硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理，申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理，申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

谢文杰先生，副总经理，金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区（除日本外）董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及

交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

任志强先生，副总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

黄小慧（HUANG Xiaoyi Helen）女士，副总经理，硕士。曾任加拿大明道银行证券公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

尤柏年先生，经济学博士。曾在澳大利亚 BConnect 咨询公司 APEX 团队从事投资、金融工程研究等工作。2007 年 6 月加入本公司先后任金融工程部高级数量分析师，海外投资部高级分析师，华宝兴业海外中国股票（QDII）基金基金经理助理兼任高级分析师。2011 年 3 月至今任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2011 年 9 月兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。

3、投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

牟旭东先生，投资副总监、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。

郭鹏飞先生，国内投资部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

刘自强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金经理。

王智慧先生，研究部总经理、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理。

蒋宁女士，投资副总监、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

（三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

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

(四) 基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》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) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，保证内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的

相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场开发等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

五、 境外投资顾问

(一) 境外投资顾问基本情况

名称：Lyxor Asset Management S.A.（领先资产管理公司）

注册地址：17 cours Valmy, Tours Societe Generale, 92800 Puteaux, France

法定代表人：Alain Dubois

成立时间：1998年

资产管理规模：962亿欧元（截至2011年2月28日）

主要联系人：Romain Barba

联系电话：(852) 216 642 91

传 真：(852) 216 646 39

(二) 境外投资顾问的职责

基金管理人(而非境外投资顾问)以受托人的身份全权管理基金的证券投资，其中会用到境外投资顾问的研究和建议。境外投资顾问的职责是根据其与基金管理人签订的《投资顾问协议》向基金管理人提供下列服务：

- 1、就基金的投资管理，以书面形式向基金管理人提供有关投资范围的一般指导和建议，包括基金的资产结构（资产配置）和相应权重。
- 2、列席投资委员会会议，讨论一般指导和建议的绩效表现。

- 3、未经基金管理人的事先书面同意，投资顾问不得将以上职能授权给任何第三方。
- 4、所有信息、意见和建议均应及时以英文形式提供给基金管理人。

六、 基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字 [2010] 1694 号《关于同意华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从 2011 年 2 月 21 日起，至 2011 年 3 月 11 日止，共募集 564,846,643.58 份基金份额，有效认购户数为 2,810 户。

七、 基金合同生效

基金合同于 2011 年 3 月 15 日生效。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 万元人民币等值资产，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 万元人民币等值资产，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

八、 基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管

(一) 基金份额申购和赎回的场所

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

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及纽约、伦敦、东京、法兰克福、香港、悉尼证券交易所同时正常交易的工作日，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申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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。

基金管理人不得在公告披露的开放时间之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2011 年 4 月 28 日起开始办理日常申购、赎回业务。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人于开始申购或赎回的 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下个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，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日所有投资地证券交易场所收市后计算的基金份额净值（折算为人民币）为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行处理，认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施三日前在至少一种指定媒体公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

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

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项，否则所提交的申购申请无效。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点或网上交易系统）必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效。

2、申购与赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记人在 T+2 日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+3 日（包括该日）后及时到销售网点或其网上交易系统查询申请的确认情况。

3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过十个工作日内划往投资者指定银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

通过代销网点或其网上交易系统、本公司直销 e 网金申购本基金单笔最低金额为 5,000 元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为 10 万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为 1,000 元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点或其网上交易系统、本公司直销 e 网金的投资人欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于 1,000 份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点或网上交易系统）保留的基金份额余额不足 1,000 份的，在赎回时需一次全部

赎回。

3、基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额

基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(六) 申购、赎回的处理方式

1、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

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

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

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

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

例：假定T日基金份额净值为1.086元，某投资人当日申购本基金10万元，对应的本次前端申购费率为1.20%，该投资人可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100000 / (1 + 1.20\%) = 98814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100000 - 98814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98814.23 / 1.086 = 90989.16 \text{ 份}$$

即：投资人投资10万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.086元，可得到90989.16份基金份额。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除相应的费用的金额，各计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{T日基金单位净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

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

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

例：某投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为三年三个月，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.150=11500 元

赎回费用=11500×0%=0 元

赎回金额=11500-0=11500 元

即：投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有期限为三年三个月，假设赎回当日基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为 11,500 元。

(七) 申购和赎回的费用及其用途

1、本基金仅接受人民币申购，赎回后，投资人得到的也是人民币。

2、申购费和赎回费

(1) 投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500 万（含）以上	每笔 1000 元
大于等于 200 万，小于 500 万	0.4%
大于等于 100 万，小于 200 万	0.8%
大于等于 50 万，小于 100 万	1.0%
50 万以下	1.2%

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、登记结算等各项费用。

(2) 赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有基金份额期限	赎回费率(%)
两年以内（含两年）	0.4%
两年—三年（含三年）	0.2%
三年以上	0%

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，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

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

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用在扣除手续费后余额不得低于赎回费总额的 25%应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率或收费方式和调低赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施三个工作日之前在指定媒体上刊登公告。

5、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况下根据市场情况制定基金促销计划，经相关代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

(八) 申购与赎回的注册登记

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

2、投资者在 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者在 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

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

(九) 巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接

受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者当日未能赎回部分则作自动延期赎回处理。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当在至少一种指定媒体予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过二十个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- (2) 本基金主要投资地的交易所交易时间正常或非正常停市；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- (4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- (5) 其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- (6) 本基金已经达到监管机构核定的本基金的募集规模；
- (7) 法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 基金主要投资地的交易所交易时间正常或非正常停市；
- (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、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一个开放日，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一个开放日但少于十个开放日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过十个开放日，暂停期间，基金管理人应每十个开放日至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过二十个开放日时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日在指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

(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，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理、且由同一注册登记机构办理登记结算的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费。基金转换的程序及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。

九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

(一) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行、国有资产无偿划转、机构合并或分立及基金注册登记机构认可的其他行为。无

论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的合格个人投资者或机构投资者。其中:

1、“继承”是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

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

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

4、“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移;

5、“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,并向其份额所在的销售机构申请办理。

(三) 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理;申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(四) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点或网上交易系统)时,应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管为一步转托管,具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请,基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构(网点或网上交易系统)。

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

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

十、基金的投资

（一）投资目标

本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金（ETF）等金融工具，在国际范围内分散投资风险，追求基金资产长期增值。

（二）基准货币

本基金的基准货币是人民币。

（三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的交易型开放式基金（ETF）、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。其中，ETF 的标的市场是美洲、欧洲、及亚太地区的发达国家和地区。具体为澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

本基金各类资产配置的比例范围为：ETF 占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金及中国证监会允许的其它投资品种的比例为基金资产的 5%-40%（现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%）。

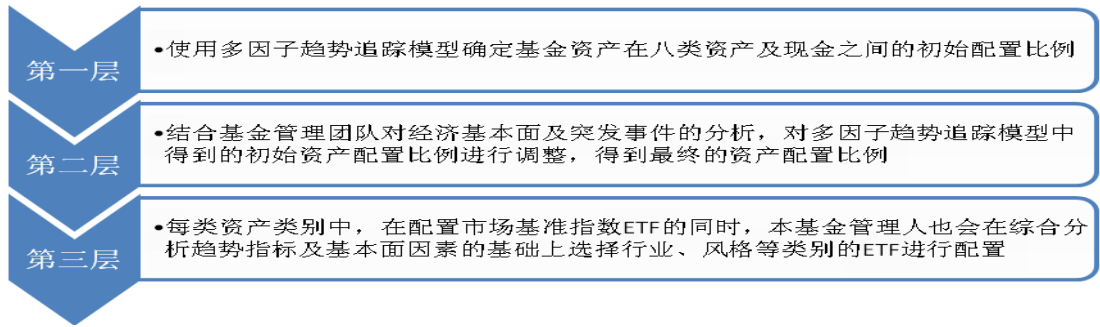
如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，根据有关法律法规，本基金投资的证券市场范围将作相应调整。如果业绩比较基准中成熟市场的覆盖发生变动，本基金投资的证券市场范围亦将作相应调整。在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

（四）投资策略

本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分，其中，将

基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。

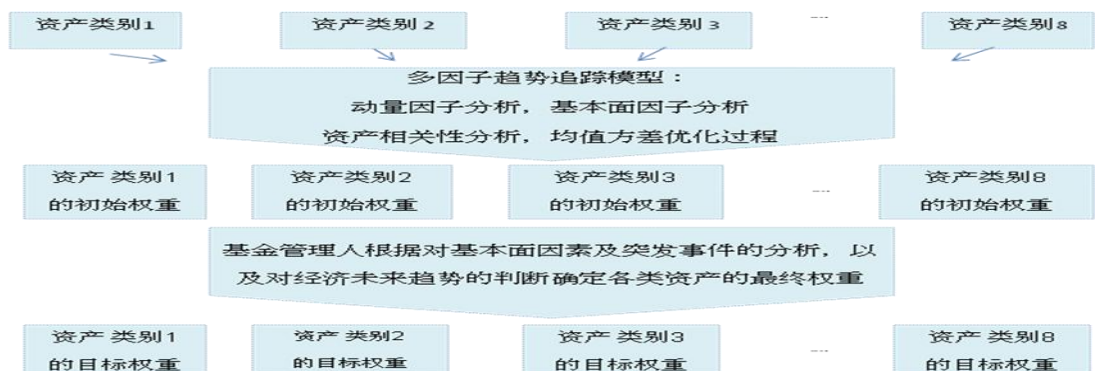
从具体运作来说，本基金的投资策略又分为以下三个层次：



1、资产配置策略

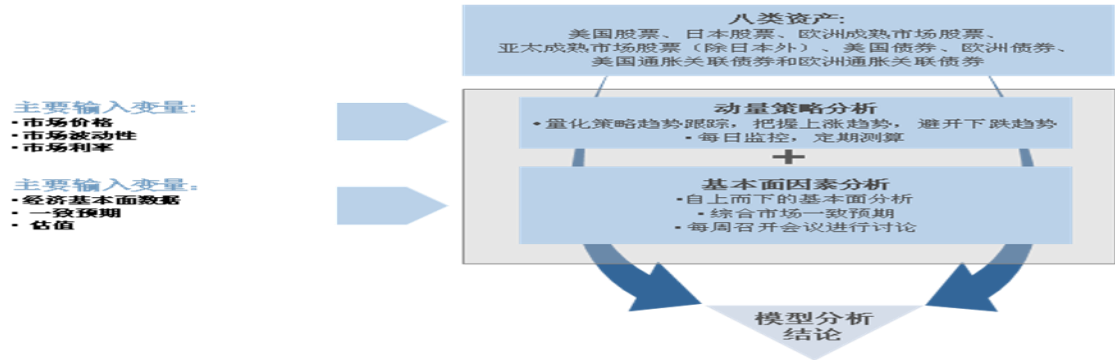
资产配置是本基金投资的重点环节，本基金会在留出足够现金头寸应对基金的短期申购赎回的前提下，重点将基金资产在以下八大类别资产之间进行动态配置，分别是：美国股票、日本股票、欧洲成熟市场股票、亚太成熟市场股票（除日本外）、美国债券、欧洲债券、美国通胀关联债券和欧洲通胀关联债券。

本基金的初步资产配置将在运用本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统分析的基础上，结合本基金投研团队对相关资产类别未来趋势的判断确定。具体流程如下：



(1) 多因子趋势追踪模型介绍

本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统是本基金整体投资策略的重要组成部分。该系统通过对相关资产类别的动量因子，基本面因子的量化分析，来确定一定时期较为强势的资产类别，综合风险和相关性的分析，确定各个资产类别的初始配置权重，把握上涨趋势，避开下跌趋势。基金成立初期，本模型的计算主要由境外投资顾问完成。



1) 动量策略

动量效应(momentum)是建立在行为金融学理论基础之上的一种统计规律，所谓动量效应是指如果某只证券或者某个证券组合在前一段时期表现较好，那么，下一段时期该证券或者证券投资组合仍将有良好表现。

本基金投资过程中资产动量的分析主要是采用投资顾问开发的合成期权分析方法，通过对各类资产类别历史收益率、波动率等指标的系统分析，把握资产的上涨趋势，避开资产的下跌趋势，并得到该类资产的预期收益率。

2) 组合收益/风险优化过程

在第一步分析的基础上，本基金将使用基于均值/方差方法的组合优化模型确定相关资产类别的初始配置权重。

通过前面的分析，本基金管理人形成对相关资产类别预期收益率的判断，再结合通过历史波动率及相关衍生品隐含波动率的分析形成本基金预期波动率的判断，以及不同资产类别之间相关性的判断等，在风险控制指标的约束下，运用马克维茨均值/方差的分析方法确定相关资产类别的初始配置比例。

3) 基本面因子分析

在以上分析的基础上，本基金会进一步借助境外投资顾问的宏观量化分析体系，综合考虑相关市场宏观经济，资本市场及经济政策等因子，根据当期特定市场环境，以及不同资产类别的特点，采用数量化的方法，对优化过程形成的初始配置权重进行调整。

本基金所涉及的部分基本面因子如下表所示：

宏观经济	资本市场
工业增加值；信心指数；	全市场 ROE、EV/EBITDA；
生产/消费物价指数；	利润率；
市场利率；大宗商品价格等	估值指标；股息率等

(2) 基金管理人的分析与判断

在多因素趋势追踪模型分析的基础上，本基金管理人将综合考虑模型分析结果、经济基本面因素及市场突发事件等，确定本基金资产配置的目标权重。

在这个过程中，本基金管理人将以模型分析的结果为主。同时辅之以对于无法量化的基金基本面指标的分析，如部分经济政策，经济周期指标等，以及对未来趋势的判断来对模型分析结果进行调整。

但是，在市场出现突发事件或某些特定的市场环境下，本基金将主要依靠基金管理团队对于相关突发事件和市场环境的分析来确定基金的资产配置，此时，资产配置的结果可能会与多因子趋势分析模型的结论有较大差异。

2、ETF 选择策略

本基金每个资产类别下 ETF 个券的选择主要分为两个部分：首先，本基金为全球资产配置型基金，因此，在确定了资产配置的比例后，本基金将在每个资产类别下重点配置跟踪该类别市场基准指数的 ETF；另外，考虑到相关市场 ETF 发展的实际情况，当入选资产

类别为股票类资产时,本基金管理人也会在控制风险的同时,积极配置该资产类别下的行业,主题和风格等子类别的 ETF, 以提高基金业绩, 为投资者获得超额收益。

(1) 市场基准指数 ETF 的选择

对于市场基准类指数 ETF, 本基金选择的标准如下:

1) 跟踪指数的市场代表性

ETF 跟踪的标的指数需有较高的市场代表性和知名度, 能够反映标的市场的整体收益水平平等。

2) 规模和流动性

基金规模的大小决定了其长期的生命力。同时, 本基金主要在二级市场上买卖 ETF; 相关二级市场的有效性非常重要。本基金将优先选择二级市场交易量大或有强大做市商的 ETF。

3) 费率和税率

在其它条件相同的情况下, 本基金将优先选择费率和税率较低的 ETF。

4) 跟踪误差

跟踪误差是衡量 ETF 基金的重要指标之一, 跟踪误差小代表指数的拟合效果好, 以及管理人较高的投资运作水平。本基金优先选择跟踪误差更小的 ETF。

5) 管理人经验

基金管理人需要具有丰富的 ETF 运作经验, 并且, 该基金的管理和研究团队应该有长期良好的历史记录, 人员稳定。同时, 该基金管理人应该具有稳健良好的财务状况, 有良好的风险控制制度和记录。本基金将优先选择该类管理人管理的 ETF。

(2) 子类别 ETF 的选择

当入选的资产类别为股票类资产时，本基金会积极配置该市场上的行业，主题，风格等子类别 ETF，子类别 ETF 的选择在考虑以上 ETF 选择标准的基础上，还将另外考虑以下指标：

1) 动量指标

本基金将采用动量方法分析相关子资产类别下的 ETF，选择动量表现较好的子类别进行配置。

2) 基本面因素

本基金在选择子类别 ETF 时，将会依据相关子类别的基本面因素，如估值水平，成长前景，比较优势等因素，辅助投资决策。

3、债券投资策略

考虑到债券相关 ETF 的流动性总体来说不如股票型 ETF，因此，当入选类别为债券类资产时，本基金将可能部分直接投资于债券。具体投资债券的策略采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法：

(1) 自上而下的配置

对该资产类别中涉及的国家/地区的宏观经济进行分析，包括对通货膨胀、GDP 增长、国际贸易、外汇储备、投资者信心、储蓄等数据的研究，及对全球市场经济发展的判断，来分析汇率和利率的发展趋势，在此基础上确定对收益率曲线的进行分析和预测，确定最优化的组合久期。

(2) 自下而上的个券选择

在公司固定收益团队研究支持下，对个券进行分析，确定具体配置的个券品种。

(五) 投资决策

1、决策依据

本基金主要依据下列因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- (1) 各国宏观经济环境及其证券市场的运行情况；
- (2) 各国货币政策、产业政策以及证券市场政策；
- (3) 市场资金供求状况及未来走势；
- (4) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2、投资流程

(1) 资产配置

在本基金运行初期，资产配置决策中的多因子趋势追踪模型模块的分析结果主要由外方投资顾问计算并提供，待基金正常运行一段时间后，本基金管理人将在外方投资顾问模型基础上，综合本基金运行实践经验，以及相关数据的积累形成自己的多因子趋势追踪模型模块。

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略和资产配置做出决策，境外投资顾问可列席投资决策委员会。基金经理根据中国证监会有关规定、基金合同、市场情况以及本基金量化模型分析的结果，拟订《资产配置提案》，明确下一阶段资产在类别和地区之间的大体配置比例范围。《资产配置提案》须在投资决策委员会上讨论通过。

在本基金运行初期，日常的资产配置程序主要是由基金经理与境外投资顾问一道完成。具体流程为：

第一，境外投资顾问每周根据多策略趋势追踪模型的计算，为基金经理提供如下数据：各类资产的隐含预期收益率（表示资产的相对强弱）；各类资产的预期波动率；基本面因子对各类资产配置比例的影响幅度；各类资产的配置比例等。同时，本基金管理人也会在境外投资顾问的帮助下，自建模型对以上数据进行计算，初期主要用于与境外投资顾问提供的数据进行比对，根据运行结果对自身模型进行不断修正和相互验证，待自建模型运行成熟后，本基金管理人将主要以自身模型的计算结果为依据，来协助进行资产的配置。

第二，在多因子趋势追踪模型分析的基础上，基金经理将综合分析投资决策委员会确定的投资比例范围和模型分析的结果，综合考虑部分不易量化的基本面因素的影响，以及对未来趋势的判断来对模型分析结果进行调整。

但是，在市场出现突发事件或某些特定的市场环境下，本基金将主要依靠投研团队对于相关突发事件和市场环境的分析来确定基金的资产配置，此时，资产配置的结果可能会与多因子趋势分析模型的结论有较大差异。

(2)ETF 组合构建

首先，基金管理人会与境外投资顾问一道，确定 ETF 备选池，并提交投资决策委员会讨论。经投资决策委员会讨论确定的股票池将作为本基金正式的备选股票池，基金经理和投资顾问每年会对 ETF 池进行调整，并提交投资决策委员会进行讨论。ETF 备选池由相关市场的具有代表性的指数 ETF 构成，对于股票类资产，也会选择行业、风格和主题等类 ETF。

在日常投资过程中，基金经理会根据资产配置过程的结果，从备选的 ETF 池中选择满足条件的 ETF 构成各个资产类别的 ETF 组合，对于股票类资产类别，基金经理会选择市场基准类 ETF 的同时，通过对海外市场行业、风格等子市场的研究来选择部分子市场 ETF 进行投资。

ETF 组合构建主要由基金经理根据基金投资策略来确定，同时也会参考境外投资顾问的建议，境外投资顾问的建议可以是 ETF 的买卖建议，但最终的决策权在于本公司。

(3)投资执行

该阶段主要由基金管理人负责。投资交易指令通过公司的全球交易平台执行。

(4)投资风险控制

该阶段工作主要由基金管理人负责。根据中国证监会和境外相关市场的监管要求，制定风险管理制度，实施有效的风险管理。

1) 基金经理会在基金日常投资过程中对投资组合的波动率，VaR，跟踪误差等风险指标

进行前端控制，通过预先设定波动率、VaR 和跟踪误差(
$$E = \sigma(D_i) = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^N (D_i - \bar{D})^2}{N-1}}$$
)，其中， D_i 表示 i 日基金资产组合收益与业绩比较基准收益之差， $i=1, 2, \dots, N$) 等风控指标的预算范围，并每周进行监控，来保证基金投资组合在预先设定的风险预算范围内运行，这项工作主要由基金经理完成，但是在早期基金管理人的资产配置模型尚未完善时，涉及需要模型

参数设置来控制的部分将主要由境外投资顾问完成；

2) 每月公司交易部门将出具月度交易报告，包括该月交易情况汇总、月末基金资产明细，以及交易指令合规性的说明，由基金经理签字后，上报公司内控审计和风险管理部、督察长；

3) 基金经理每月向投资总监提交所管理境外证券投资基金的投资总结，投资总结应附有所管辖基金资产投资组合的财务报表及基金有关遵守《华宝兴业境外证券投资管理制度》、《基金合同》、《资产配置、区域配置方案》所规定的框架进行投资的声明。投资总监应定期复核投资经理的所有交易记录，确保各基金投资组合的操作符合《基金合同》和投资决策委员会的要求；

4) 内控审计风险管理部通过交易数据的核对，对前日交易操作进行复核，如发现违反证监会《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和公司相关管理制度的交易操作，须立刻向副总经理汇报，并同时通报督察长、境外投资团队；

5) 督察长、副总经理和内控审计风险管理部人员对投资决策和投资执行的过程进行监督检查，并对有关数据和资料进行备案。

(5) 投资业绩评估

1) 公司境外投资业绩评估委员会每月召开会议，评估基金的整体运作绩效、基金经理的管理能力，确定公司在对外宣传材料中对基金业绩、策略的说明。同时也对境外投资顾问和境外券商的业绩做出评价；

2) 公司内控审计和风险管理部负责对相关部门的业绩报告进行确认和评估，在此基础上，做进一步的绩效分析；

3) 公司境外投资团队、境外研究小组每月编写境外投资顾问评估报告，提交公司绩效评估委员会进行讨论和评价。

(六) 业绩比较基准

50%MSCI 全球指数（此处指全收益指数）+50%花旗全球政府债券指数

MSCI 全球指数 (MSCI World Index) 是 MSCI Barra 指数公司编制的自由流通市值加权指数, 主要用来衡量全球发达市场的表现。截至 2010 年 2 月, MSCI 全球指数包含 23 个发达国家市场, 分别为: 澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。共 1654 家上市公司, 总市值共计 21 万亿美元。

花旗全球政府债券指数 (World Government Bond Index) 是由花旗集团指数部门采用市值加权的方法编制, 包括 23 个国家的政府债券, 包括: 澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、爱尔兰、意大利、日本、马来西亚、荷兰、挪威、波兰、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

当市场出现更合适, 更权威的比较基准时, 经基金托管人同意, 本基金管理人履行适当的程序后, 可以选用新的比较基准, 并将及时公告。

(七) 风险—收益特征

在正常市场情况下, 本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金, 属于中等预期风险和收益的证券投资品种, 其预期风险和收益水平低于全球股票型基金, 高于债券基金和货币市场基金。

在部分极端市场情况下, 本基金存在策略失效的风险, 此时的预期风险水平可能会显著增加。

(八) 投资限制

1、持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

2、本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

3、本基金投资基金资产的比例, 不得低于基金净值的 60%。

4、每只境外基金投资比例不超过本基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

5、本基金不得投资于以下基金：

- (1) 其他基金中基金；
- (2) 联接基金（A Feeder Fund）；
- (3) 投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

6、中国证监会对投资限制的其他规定。

若超过上述第 1 项—第 6 项的投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

（九）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、购买不动产。

2、购买房地产抵押按揭。

3、购买贵金属或代表贵金属的凭证。

4、购买实物商品。

5、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金财产净值的 10%。

6、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。

7、参与未持有基础资产的卖空交易。

8、从事证券承销业务。

9、向他人贷款或者提供担保。

10、从事承担无限责任的投资。

11、买卖其他基金份额，但是监管部门另有规定的除外。

12、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、境外托管人发行的股票或者债券。

13、买卖与其基金管理人、基金托管人、境外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。

14、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。

15、不公平对待不同客户或不同投资组合。

16、除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

17、依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当公告程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（十）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

（十一）基金管理人代表基金行使所投资证券产生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债权人权利，保护基金投资者的利益。

2、有利于基金财产的安全与增值。

（十二）证券交易管理

1、经纪商选择标准

（1）交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

（2）研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

（3）财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

（4）后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

（5）组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（6）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、交易量分配

基金管理人将根据上述标准对经纪商进行综合考察，选取最适合基金投资业务的经纪商合作，并根据综合考察结果分配基金在各个经纪商的交易量。

3、佣金管理

基金管理人将根据经纪商提供的服务内容和服务质量，按照最佳市场惯例原则确定佣金费率。交易佣金如有折扣或返还，应归入基金资产。

（十三）基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至 2012 年 6 月 30 日, 本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中: 普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	48,998,954.45	64.49
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,926,908.90	35.44
8	其他各项资产	53,337.49	0.07
9	合计	75,979,200.84	100.00

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合¹

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF 基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Management	6,898,694.93	10.01
2	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	6,033,258.86	8.76
3	VANGUARD LONG-TERM Corporate BOND ETF	ETF 基金	开放式	Vanguard Group Inc	3,947,053.85	5.73
4	ISHARES MSCI Hong Kong	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,474,900.06	5.04
5	SPDR BARCLAYS CAPITAL 1-3 MO	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	3,418,975.29	4.96
6	ISHARES BARCLAYS 1-3 YEAR TR	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,415,243.60	4.96
7	ISHARES BG EURO INF LNKD BND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,221,332.69	4.68
8	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	3,187,749.60	4.63
9	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	2,909,454.00	4.22
10	DB X-TRACKERS MSCI PAC X-JPN	ETF 基金	开放式	DB X-TRACKERS	2,810,419.26	4.08

10、投资组合报告附注

(1) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

(2) 本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	51,199.50
4	应收利息	751.29
5	应收申购款	1,386.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,337.49

(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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

十一、基金的业绩

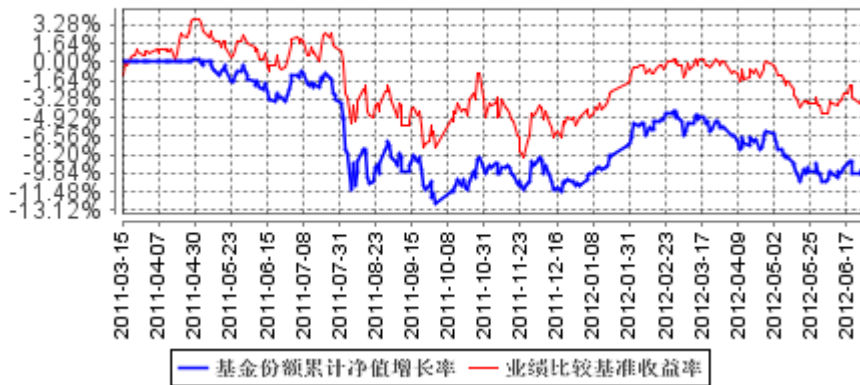
基金业绩截止日为2012年6月30日,所列数据未经审计。

1、净值增长率与同期比较基准收益率比较:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准 差 ②	业绩比较 基准收益 率 ③	业绩比较 基准收益 率标准 差 ④	①-③	②-④
2011/03/15-2011/1 2/31	-10.90%	0.72%	-4.87%	0.82%	-6.03%	-0.10%
2012/01/01-2012/0 6/30	2.36%	0.50%	3.64%	0.47%	-1.28%	0.03%
2011/03/15-2012/6 /30	-8.80%	0.65%	-1.41%	0.71%	-7.39%	-0.06%

2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较:

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定,自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合,截至 2011 年 9 月 15 日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

十二、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费, 含境外投资顾问收取的费用;

(2) 基金托管人的托管费, 含境外托管人收取的费用;

(3) 基金的证券交易和清算费用;

(4) 基金合同生效以后的信息披露费用;

(5) 基金份额持有人大会费用;

(6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(7) 基金的资金汇划费用;

(8) 外汇兑换交易的相关费用;

(9) 在证监会规定允许的前提下, 本基金可以从基金财产中计提销售服务费, 具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

基金的各项费用以人民币提取, 以人民币支付。

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托境外投资顾问，包括投资顾问费）按基金财产净值的 1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向境外托管人支付的相应服务费）按基金财产净值的 0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目：

本条第 1 款约定以外的其他费用，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。

4、基金费用调整

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

5、税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，依照国家法律法规和基金投资所在地的法律法规的规定履行纳税义务。

十三、基金财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

本基金基金财产净值是指基金资产总值减去负债（含各项有关税收）后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，根据投资所在地规定及境外托管人的相关要求，在境外开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、境外投资顾问和境外托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人和境外托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金托管人和境外托管人应安全保管基金财产。

3、基金管理人、基金托管人、境外投资顾问、境外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。

4、基金托管人或境外托管人按照规定或境外市场惯例开设基金财产的所有资金账户和证券账户。

5、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。

6、基金管理人、基金托管人、境外投资顾问、境外托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。基金管理人、基金托管人、境外投资顾问、境外托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

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

十四、基金资产估值

（一）估值目的

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

（二）估值频率

基金合同生效后，每个工作日对基金资产进行估值，T+1日完成T日估值。

（三）估值对象

本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

（四）估值方法

1、已上市流通的有价证券，以其所挂牌证券交易所估值日的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2、对于非上市证券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，即首选按估值日的最近买价估值。

3、在任何情况下，基金管理人如采用本项第1、2小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1、2小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

5、估值中的汇率选取原则：

人民币对主要外币的汇率以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及其他货币对人民币的汇率，采用彭博金融终端提供的估值日各种货币对美元折算率并采用套算的方法进行折算。

6、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

（五）估值程序

1、基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面

形式发送基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

2、基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自应承担的责任。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的主要证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外托管人、投资顾问无法准确评估基金财产价值时；

3、中国证监会认定的其它情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一工作日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。

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

（八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人和基金托管人应查找原因，及时对当日账务进行纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条（四）估值方法中的第 3 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券交易机构、登记清算公司或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化、市场规则变更以及由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采

取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金收益与分配

（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基金费用和税收后的余额；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资产负债表中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

1、基金收益分配是指按规定将基金的可供分配利润按基金份额进行比例分配。

2、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

4、本基金收益分配方式

（1）本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

（2）分红方式的设置与变更

投资人可在销售机构处对托管在该处的基金通过账户分红方式或基金分红方式的设置和变更进行分红方式的选择；

投资人在销售机构处选择的账户分红方式，是针对该销售机构账户内所有的该项选择后新增的且未作基金分红方式选择的基金品种的分红方式。投资人若要修改某销售机构基金交易账户内单个基金品种的分红方式需提交变更基金分红方式的申请，基金分红方式变更确认后对该销售机构账户内托管的该基金品种全部份额有效。

投资人既未作账户分红方式选择也未作基金分红方式选择的情况下，分红方式根据本条

第(1)项所述的默认分红方式确定,否则不再适用本条第(1)项所述的默认分红方式规则。

5、在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%;

6、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

7、基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

8、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四) 收益分配方案

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

(五) 收益分配方案的确定与公告

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

(六) 收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

十六、基金的会计与审计

(一) 基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。

2、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

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

7、基金管理人可委托其他机构办理基金核算、估值事宜，基金托管人可委托境外机构代为履行复核基金份额净值等受托人职责。

（二）基金年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后在 2 日内披露。

十七、基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

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

（二）基金份额发售公告

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

(三) 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

(四) 基金财产净值、基金份额净值公告

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

在开始办理基金份额申购或赎回之后,基金管理人应当在 T+2 日(T 日为开放日)通过网站、基金份额发售网点或其网上交易系统以及其他指定媒体,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金财产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日后 2 日,将基金财产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和网站上。

(五) 定期报告

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

1、基金年度报告:基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金半年度报告:基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告:基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

(六) 临时报告与公告

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

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

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

27、基金运作期间如遇境外投资顾问主要负责人员变动，基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响；

28、中国证监会规定的其他事项。

（七）公开澄清

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

（八）信息披露文件的存放与查阅

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

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

十八、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、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项应经基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

（二）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；

2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，发布基金财产清算公告，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

十九、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2011 年末，中国银行各类托管资产规模突破两万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2012 年 6 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开

放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普 500 等权重指数（QDII）、长信标普 100 等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球自然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以

及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

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

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

二十、境外托管人

一、境外托管人基本情况

名称：[中国银行(香港)有限公司]

住所：[香港花园道1号中银大厦]

办公地址：[香港花园道1号中银大厦]

法定代表人：[和广北总裁]

成立时间：[1964年10月16日]

组织形式：[股份有限公司]

存续期间：[持续经营]

联系人：[黄晚仪 副总经理 托管业务主管]

联系电话：[852-3982-3753]

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于1964年成立，并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司

（“中银香港(控股)”）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2011 年 12 月 31 日，中银香港的总资产为 2,157.3 亿美元，资本总额为 155.6 亿美元，其中实收资本为 55.2 亿美元，至于资本充足比率更达 16.9%。中银香港的财务实力及双 A 级信用评级，可以媲美不少大型全球托管银行。中银香港(控股)最新信评如下(截至 2011 年 12 月 31 日)：

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
基本实力 / 财务实力	C+		-

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其理财产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，及于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行等，其业务专长及全方位的配备，令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行。

截至 2011 年 12 月 31 日止，中银香港(控股)的托管资产规模为 4,000 亿港元。

二、托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

(一) 主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一，由管理委员会成员兼副总裁王仕雄先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有十七名骨干成员，职级均为经理或以上，分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、及营销等方面。骨干人员均来自各大跨国银行，平均具备 15 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管)，并操流利普通话，可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理，中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队，以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外，若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务，则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司（“中银保诚”）提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司，中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务，其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名，人员平均具备 10 年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视，有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外，其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提供，力求以最高水平服务各机构性客户。

二十一、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构:

(1) 直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

住所: 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人: 郑安国

直销柜台电话: 021-38505731、38505732、021-38505888-301 或 302

直销柜台传真: 021-50499663、50499667、50988055

网址: www.fsfund.com

(2) 直销 e 网金

投资者可以通过本公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的申(认)购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址: www.fsfund.com。

2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

住所: 北京市复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人: 肖钢

客户服务电话: 95566

网址: www.boc.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

(3) 中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83198888

公司网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

(6) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(7) 平安银行股份有限公司

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：倪苏云

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(9) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

网址：www.cbhb.com.cn

客户服务电话：400 888 8811

(10) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

服务热线：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

(11) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务热线：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(12) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：李笑鸣

公司网址：www.htsec.com

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

电话：010-66568430

联系人：田薇

公司网址：www.chinastock.com.cn

(14) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：400-8888-108(免长途费)

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

(15) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

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

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

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

(16) 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

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

(17) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

网址：<http://www.dwzq.com.cn>

(18) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客服电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

(19) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626172

客服电话：95511—8

公司网址：<http://www.pingan.com>

(20) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

公司网址：www.ce.ecitic.com

(21) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21F-29F

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

(22) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

(23) 中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

客户服务电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(24) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 楼至 26 楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755—82130833

传真：0755-82133952

客户服务热线：95536

国信证券网站：www.guosen.com.cn

(25) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507—1510 室）

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

法定代表人：张智河

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(26) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025—84457777—882

传真：025—84579763

联系人：万鸣

公司网址：www.htsc.com.cn

客户服务热线：95597

(27) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

咨询电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

传真：021-50372474

(28) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

联系电话：0471-4972343

网址：www.cnht.com.cn

(29) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

客户服务热线： 0755-33680000、400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

(30) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话： 4006515988

网址：<http://www.bhzq.com>

(31) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 18-21 层

法定代表人：杨明辉

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

(32) 国元证券股份有限公司

注册地址：合肥寿春路 179 号

法人代表：凤良志

客户服务热线：4008888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

(33) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

联系人：余江

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

(34) 中国国际金融有限公司

住所：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

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

(35) 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 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898、021-38929908

公司网站：<http://www.cnhbstock.com>

(36) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(37) 华福证券有限责任公司

地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(38) 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

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(39) 江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

客服电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(40) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(41) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

(42) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24 层-32 层

法定代表人：李工

公司电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

网址：www.hazq.com

客户服务电话：0551-96518、400-80-96518

(43) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888

传真：021-53519888

网址：www.962518.com

客户服务电话：4008918918、021-962518

(44) 方正证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

全国统一客服热线：95571

方正证券网站：www.foundersc.com

(45) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

公司地址：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

全国统一客服热线：400-888-8588

东海证券网站：<http://www.longone.com.cn>

(46) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

联系电话：0791-86768681

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

(47) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：余政

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

网址：www.msyzq.com

客户服务电话：4006198888

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构：华宝兴业基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

电话：021—38505888

传真：021—38505777

联系人：韩东霞

(三) 律师事务所和经办律师

名称：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：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张鸿

经办注册会计师：薛竞 张鸿

二十二、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利及义务

1、基金管理人

(1) 基金管理人基本情况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

成立日期：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

(2) 基金管理人的权利

- 1) 依法申请并募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 依照法律法规和基金合同独立运用基金财产；
- 3) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
- 5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- 6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权依据法律法规和基金合同的规定对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 根据基金合同的规定选择、更换适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代

销机构行为进行必要的监督和检查；

8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；

11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

15) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

17) 根据有关规定，选择境外投资顾问、证券经纪代理商以及证券登记机构，并对其进行必要监督；

18) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

19) 选择、更换或撤销境外基金投资顾问；

20) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

21) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

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

3) 办理基金备案手续；

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

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

- 6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案, 及时向基金份额持有人分配基金收益;
- 7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;
- 8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
- 9) 依法接受基金托管人的监督;
- 10) 编制中期和年度基金报告;
- 11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
- 12) 计算并公告基金财产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;
- 13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;
- 14) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予以保密, 不得向他人泄露;
- 15) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
- 16) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料;
- 17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- 18) 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
- 19) 组织并参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- 22) 确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具, 严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定确定清晰、可执行的投资范围和投资比例, 并在规定时间内, 对超范围、超比例的投资进行调整;
- 23) 承担受信责任, 在挑选、委托投资顾问过程中, 履行尽职调查义务, 对其委托的境外投资顾问及其他第三方机构的相关事项的法律后果承担责任。
- 24) 法律法规、中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人

(1) 基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

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

(2) 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 选择、更换境外托管人并与其签署有关协议；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3) 基金托管人的义务

- 1) 安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

- 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，负责基金财产境内托管事宜；
- 3) 按规定开设基金财产的资金帐户和证券帐户；
- 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；
- 5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- 6) 按照有关法律法规和基金合同的规定以受托人名义或其指定的代理人名义登记资产；
- 7) 每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- 8) 办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- 9) 选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，托管人应当承担相应责任；
- 10) 保管（或委托境外托管人）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；
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；
- 12) 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；
- 13) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- 14) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 15) 对基金财务会计报告、半年度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；
- 16) 保存基金份额持有人名册；
- 17) 复核基金管理人计算的基金财产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- 18) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 19) 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；
- 20) 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；
- 21) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

22) 因过错违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除; 除法律法规另有规定外, 基金托管人不承担连带责任;

23) 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;

24) 对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任;

25) 法律法规、中国证监会和外管局规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人

(1) 基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受, 基金投资者自依据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当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

(2) 基金份额持有人的权利

1) 分享基金财产收益;

2) 参与分配清算后的剩余基金财产;

3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;

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

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7) 监督基金管理人的投资运作;

8) 对基金管理人、基金托管人、损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3) 基金份额持有人的义务

1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用;

3) 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动;

5) 执行基金份额持有人大会的决议;

6) 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人、基金托管人、各自委托的第三方机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利;

7) 基金份额持有人应遵守基金管理人、基金托管人、代理销售机构和注册登记机构的

相关交易及业务规则；

8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人和/或其合法授权代表组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(4) 更换基金管理人、基金托管人；

(5) 变更基金类别；

(6) 变更基金投资目标、范围或策略；

(7) 变更基金份额持有人大会程序；

(8) 本基金与其它基金合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10) 法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；

(8) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

(4) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

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

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 会议形式；

(4) 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；

(5) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(6) 会务常设联系人姓名、电话；

(7) 权益登记日；

如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

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

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定，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) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按本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) 召集人在监督人和其聘请的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，如监督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或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

(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其它代表，

同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，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；

(6) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第(二)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

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

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。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。

6) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

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

8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人（或其授权代表）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人（或其授权代表）所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过方为有效。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见即视为有效表决。

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

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

9、计票

(1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人授权的人员担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人授

权的人员担任)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/或授权代表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并由大会主持人当场公布计票结果。

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

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

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。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内,由基金份额持有人大会召集人在指定媒体公告。

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

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金的收益与分配

1、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基金费用和税收后的余额；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。

2、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资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可供分配利润按基金份额进行比例分配。

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金收益分配方式

1) 本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2) 分红方式的设置与变更

具体规定在招募说明书中列示。

(4) 在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4、收益分配方案

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

5、收益分配方案的确定与公告

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

6、收益分配中发生的费用

(1) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

(2) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

(四) 基金的费用

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；

(2) 基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用；

(3) 基金的证券交易和清算费用；

(4) 基金合同生效以后的信息披露费用；

(5) 基金份额持有人大会费用；

(6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；

(7) 基金的资金汇划费用；

(8) 外汇兑换交易的相关费用；

(9) 在证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托境外投资顾问，包括投资顾问费）按基金财产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向境外托管人其支付的相应服务费)按基金财产净值的 0.3%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金财产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第(一)款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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。

4、基金费用调整

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

5、税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体,依照国家法律法规和基金投资所在地的法律法规的规定履行纳税义务。

(五) 基金的投资

1、投资目标

本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金(ETF)等金融工具,在国际范围内分散投资风险,追求基金资产长期增值。

2、基准货币

本基金的基准货币是人民币。

3、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的交易型开放式基金(ETF)、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。其中,ETF的标的市场是美洲、欧洲、及亚太地区的发达国家和地区。具体为澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

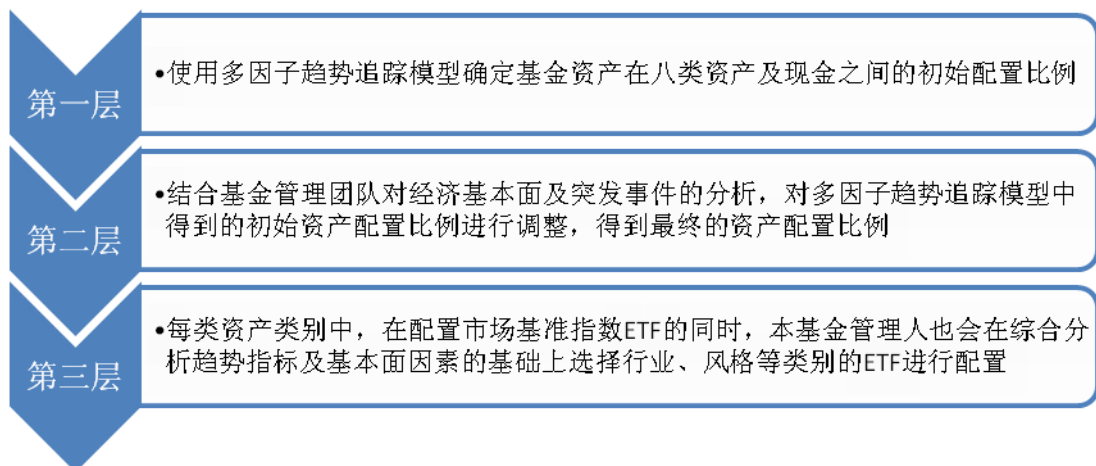
本基金各类资产配置的比例范围为:ETF占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金及中国证监会允许的其它投资品种的比例为基金资产的5%-40%(现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%)。

如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更,根据有关法律法规,本基金投资的证券市场范围将作相应调整。如果业绩比较基准中成熟市场的覆盖发生变动,本基金投资的证券市场范围亦将作相应调整。在有关法律法规发生变动时,本基金资产配置比例等应作相应调整。

4、投资策略

本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分,其中,将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。

从具体运作来说,本基金的投资策略又分为以下三个层次:

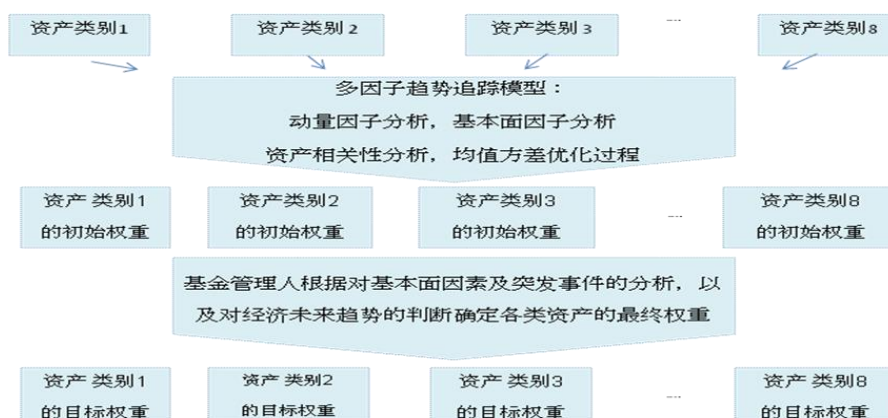


(1) 资产配置策略

资产配置是本基金投资的重点环节,本基金会在留出足够现金头寸应对基金的短期申购

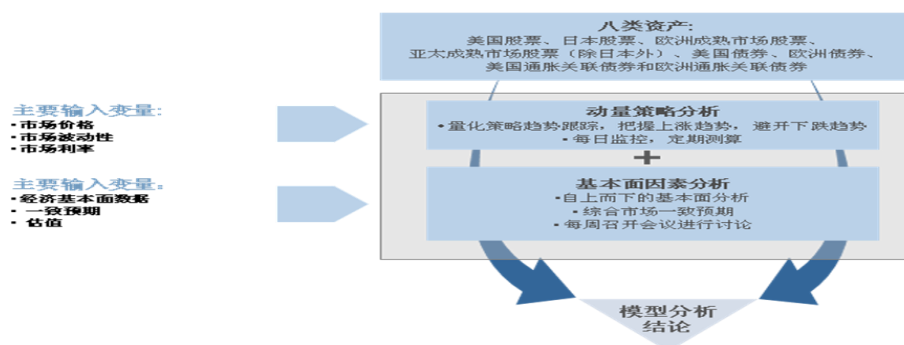
赎回的前提下，重点将基金资产在以下八大类别资产之间进行动态配置，分别是：美国股票、日本股票、欧洲成熟市场股票、亚太成熟市场股票（除日本外）、美国债券、欧洲债券、美国通胀关联债券和欧洲通胀关联债券。

本基金的初步资产配置将在运用本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统分析的基础上，结合本基金投研团队对相关资产类别未来趋势的判断确定。具体流程如下：



1) 多因子趋势追踪模型介绍

本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统是本基金整体投资策略的重要组成部分。该系统通过对相关资产类别的动量因子，基本面因子的量化分析，来确定一定时期较为强势的资产类别，综合风险和相关的分析，确定各个资产类别的初始配置权重，把握上涨趋势，避开下跌趋势。基金成立初期，本模型的计算主要由境外投资顾问完成。



A、动量策略

动量效应 (momentum) 是建立在行为金融学理论基础之上的一种统计规律，所谓动量效应是指如果某只证券或者某个证券组合在前一段时期表现较好，那么，下一段时期该证券或

者证券投资组合仍将有良好表现。

本基金投资过程中资产动量的分析主要是采用投资顾问开发的合成期权分析方法，通过对各类资产类别历史收益率、波动率等指标的系统分析，把握资产的上涨趋势，避开资产的下跌趋势，并得到该类资产的预期收益率。

B、组合收益/风险优化过程

在第一步分析的基础上，本基金将使用基于均值/方差方法的组合优化模型确定相关资产类别的初始配置权重。

通过前面的分析，本基金管理人形成对相关资产类别预期收益率的判断，再结合通过历史波动率及相关衍生品隐含波动率的分析形成本基金预期波动率的判断，以及不同资产类别之间相关性的判断等，在风险控制指标的约束下，运用马克维茨均值/方差的分析方法确定相关资产类别的初始配置比例。

C、基本面因子分析

在以上分析的基础上，本基金将进一步借助境外投资顾问的宏观量化分析体系，综合考虑相关市场宏观经济，资本市场及经济政策等因子，根据当期特定市场环境，以及不同资产类别的特点，采用数量化的方法，对优化过程形成的初始配置权重进行调整。

本基金所涉及的部分基本面因子如下表所示：

宏观经济	资本市场
工业增加值；信心指数；	全市场 ROE、EV/EBITDA；
生产/消费物价指数；	利润率；
市场利率；大宗商品价格等	估值指标；股息率等

D、基金管理人的分析与判断

在多因素趋势追踪模型分析的基础上，本基金管理人将综合考虑模型分析结果、经济基本面因素及市场突发事件等，确定本基金资产配置的目标权重。

在这个过程中，本基金管理人将以模型分析的结果为主。同时辅之以对于无法量化的基金基本面指标的分析，如部分经济政策，经济周期指标等，以及对未来趋势的判断来对模型分析结果进行调整。

但是，在市场出现突发事件或某些特定的市场环境下，本基金将主要依靠基金管理团队对于相关突发事件和市场环境的分析来确定基金的资产配置，此时，资产配置的结果可能

会与多因子趋势分析模型的结论有较大差异。

(2) ETF 选择策略

本基金每个资产类别下 ETF 个券的选择主要分为两个部分：首先，本基金为全球资产配置型基金，因此，在确定了资产配置的比例后，本基金将在每个资产类别下重点配置跟踪该类别市场基准指数的 ETF；另外，考虑到相关市场 ETF 发展的实际情况，当入选资产类别为股票类资产时，本基金管理人也会在控制风险的同时，积极配置该资产类别下的行业、主题和风格等子类别的 ETF，以提高基金业绩，为投资者获得超额收益。

1) 市场基准指数 ETF 的选择

对于市场基准类指数 ETF，本基金选择的标准如下：

A、跟踪指数的市场代表性

ETF 跟踪的标的指数需有较高的市场代表性和知名度，能够反映标的市场的整体收益水平平等。

B、规模和流动性

基金规模的大小决定了其长期的生命力。同时，本基金主要在二级市场上买卖 ETF；相关二级市场的有效性非常重要。本基金将优先选择二级市场交易量大或有强大做市商的 ETF。

C、费率和税率

在其它条件相同的情况下，本基金将优先选择费率和税率较低的 ETF。

D、跟踪误差

跟踪误差是衡量 ETF 基金的重要指标之一，跟踪误差小代表指数的拟合效果好，以及管理人较高的投资运作水平。本基金优先选择跟踪误差更小的 ETF。

E、管理人经验

基金管理人需要具有丰富的 ETF 运作经验，并且，该基金的管理和研究团队应该有长期良好的历史记录，人员稳定。同时，该基金管理人应该具有稳健良好的财务状况，有良好的风险控制制度和记录。本基金将优先选择该类管理人管理的 ETF。

2) 子类别 ETF 的选择

当入选的资产类别为股票类资产时，本基金会积极配置该市场上的行业，主题，风格等子类别 ETF，子类别 ETF 的选择在考虑以上 ETF 选择标准的基础上，还将另外考虑以下指标：

A、动量指标

本基金将采用动量方法分析相关子资产类别下的 ETF，选择动量表现较好的子类别进行

配置。

B、基本面因素

本基金在选择子类别 ETF 时，将会依据相关子类别的基本面因素，如估值水平，成长前景，比较优势等因素，辅助投资决策。

(3) 债券投资策略

考虑到债券相关 ETF 的流动性总体来说不如股票型 ETF，因此，当入选类别为债券类资产时，本基金将可能部分直接投资于债券。具体投资债券的策略采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法：

1) 自上而下的配置

对该资产类别中涉及的国家/地区的宏观经济进行分析，包括对通货膨胀、GDP 增长、国际贸易、外汇储备、投资者信心、储蓄等数据的研究，及对全球市场经济发展的判断，来分析汇率和利率的发展趋势，在此基础上确定对收益率曲线的进行分析和预测，确定最优化的组合久期。

2) 自下而上的个券选择

在公司固定收益团队研究支持下，对个券进行分析，确定具体配置的个券品种。

5、业绩比较基准

50%MSCI 全球指数（此处指全收益指数）+50%花旗全球政府债券指数

MSCI 全球指数（MSCI World Index）是 MSCI Barra 指数公司编制的自由流通市值加权指数，主要用来衡量全球发达市场的表现。截至 2010 年 2 月，MSCI 全球指数包含 23 个发达国家市场，分别为：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。共 1654 家上市公司，总市值共计 21 万亿美元。

花旗全球政府债券指数（World Government Bond Index）是由花旗集团指数部门采用市值加权的方法编制，包括 23 个国家的政府债券，包括：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、爱尔兰、意大利、日本、马来西亚、荷兰、挪威、波兰、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

当市场出现更合适，更权威的比较基准时，经基金托管人同意，本基金管理人履行适当的程序后，可以选用新的比较基准，并将及时公告。

6、风险收益特征

在正常市场情况下，本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金，属于中等预期风险

和收益的证券投资品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金，高于债券基金和货币市场基金。

在部分极端市场情况下，本基金存在策略失效的风险，此时的预期风险水平可能会显著增加。

有关本基金详细的风险揭示及风险管理方法请见本基金招募说明书相关部分。

7、投资限制

(1) 持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(3) 本基金投资基金资产的比例，不得低于基金净值的 60%。

(4) 每只境外基金投资比例不超过本基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

(5) 本基金不得投资于以下基金：

- 1) 其他基金中基金；
- 2) 联接基金 (A Feeder Fund)；
- 3) 投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

(6) 中国证监会对投资限制的其他规定。

若超过上述第 (1) 项—第 (6) 项的投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

8、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) 购买不动产；
- (2) 购买房地产抵押按揭；
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (4) 购买实物商品；
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金财产净值的 10%；
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (8) 从事证券承销业务；
- (9) 向他人贷款或者提供担保；
- (10) 从事承担无限责任的投资；
- (11) 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、境外托管人发行的股票或者债券；
- (12) 买卖与其基金管理人、基金托管人、境外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；
- (13) 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；
- (14) 不公平对待不同客户或不同投资组合；
- (15) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；
- (16) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

9、若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

10、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

11、基金管理人代表基金行使所投资证券产生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债权人权利，保护基金投资者的利益；

(2) 有利于基金财产的安全与增值。

(六) 基金财产的估值

1、估值目的

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

2、估值频率

基金合同生效后，每个工作日对基金财产进行估值，T+1 日完成 T 日估值。

3、估值对象

本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

4、估值方法

(1) 已上市流通的有价证券，以其所挂牌证券交易所估值日的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 对于非上市证券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，即首选按估值日的最近买价估值。

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1、2 小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1、2 小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

(5) 估值中的汇率选取原则：

人民币对主要外汇的汇率以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；估值日中国人民银行或其授权机构未公布人民币汇率中间价的，以估值日最近一日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。外汇币种之间的兑换汇率将按照彭博金融终端提供的最近一日的兑换价格为准。

(6) 税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

5、估值程序

(1) 基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面形式发送基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(2) 基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自应承担的责任。

6、暂停估值的情形

(1) 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、境外托管人、投资顾问无法准确评估基金财产价值时；

(3) 中国证监会认定的其它情形。

7、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一工作日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。

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

8、估值错误的处理

(1) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

(2) 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人和基金托管人应查找原因，及时对当日账务进行纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

9、特殊情形的处理

(1) 基金管理人按本条（四）估值方法中的第 4 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

(2) 由于证券交易机构、登记清算公司或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化、市场规则变更以及由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（七）基金财产净值、基金份额净值公告

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

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在 T+2 日（T 日为开放日）通过

网站、基金份额发售网点和其网上交易系统、以及其他指定媒体，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金财产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日后 2 日，将基金财产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和网站上。

（八）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项应经基金份额持有人大会决议通过；

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

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

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，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；

（2）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

（3）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

1)自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注

册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

(3) 清算程序

1) 基金合同终止情形发生后，发布基金财产清算公告，由基金财产清算组统一接管基金财产；

2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

4) 对基金财产进行评估和变现；

5) 制作清算报告；

6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

8) 对基金财产进行分配。

(4) 清算费用

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

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

1) 支付清算费用；

2) 交纳所欠税款；

3) 清偿基金债务；

4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

(6) 基金财产清算的公告

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

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

(九) 争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起 60 日内未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(十) 基金合同的效力

1、本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，于基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

2、本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持二份，每份具有同等的法律效力。

5、基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资者查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十三、基金托管协议内容摘要

(一) 基金托管协议当事人

1、基金管理人

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

成立日期：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本： 1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖 钢

成立时间：1983 年 10 月 31 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

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）基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

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

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

2) 对基金投资、融资比例进行监督；

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

公司名单，基金托管人和基金管理人均有责任保证该名单的真实、准确和完整，并及时将更新后的名单发送给对方；

4) 基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《有关问题的通知》要求的交易对手组成。基金托管人只对进行金融衍生品、证券借贷、回购交易之交易对手作出监督。监管范围并不包括一般证券买卖之券商。

基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督；

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

6) 对法律法规规定及《基金合同》中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

(3) 基金托管人发现基金管理人或其投资顾问的违规行为，应及时以书面形式或双方书面同意的方式通知基金管理人，由基金管理人或由基金管理人责成投资顾问限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正或基金管理人未责成投资顾问纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(4) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本协议对基金业务执行监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正违规或违约行为，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要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(5) 基金托管人对投资管理人对基金财产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后，进行交易后的投资监控和报告。

(6) 基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性可能受限于基金管理人或其投资顾问及其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作

任何担保、暗示或表示,并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

(7) 基金托管人对基金管理人或其投资顾问的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

2、基金管理人 对基金托管人的业务核查

(1) 在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权依据法律法规和《基金合同》的规定对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金财产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

(三) 基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外投资顾问和境外托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的所有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) 基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。

(6) 现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。

(7) 托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例,支付现金、

办理证券登记等托管业务。

2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。

(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《基金合同》及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，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。验资完成后，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并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户，并委托境外托管人开立境外资金账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

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

(4) 基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外资产托管人处，按照当地市场法律法规规定、该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。

(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以及各自委托均不得出借或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相关证明文件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) 除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

(5) 基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

5、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，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和《基金合同》的规定，由基金托管人或境外资产托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 投资市场所在国家或地区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。

6、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。

基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

(四) 基金财产净值计算与会计复核

基金财产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

1、基金财产净值的计算和复核

(1) 基金财产净值

基金财产净值是指基金财产总值减去负债（含各项有关税收）后的金额。基金份额净值是指基金财产净值除以基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(2) 复核程序

基金管理人每个工作日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基

金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。每个工作日上午 12:00 之前,基金管理人将前一估值日的基金估值结果以传真或双方书面同意的其它方式发给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在当日 18:00 之前盖章或签字后以传真方式将复核结果传送给基金管理人,由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

(5) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内(含第三位)发生差错时,视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时,基金管理人和基金托管人应查找原因,及时对当日账务进行纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;计价错误达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应通报基金托管人并向中国证监会备案;当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的,按其规定处理。

(6) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差并且偏差在合理的范围内,基金份额净值以基金管理人的计算结果为准,基金管理费和基金托管费也应以基金管理人的净值计算结果计提。

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

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

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

2、基金会计核算

(1) 基金账册的建立

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

(2) 会计数据和财务指标的核对

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

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 45 日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 70 日内，基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度终了后 90 日内予以公告。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告，半年度报告或者年度报告。

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

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

（五）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

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

3、基金份额持有人名册的保管

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

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、《基金合同》和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行《基金合同》和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

（六）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解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于

北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应各自继续履行《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。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（七）托管协议的修改、终止与基金财产的清算

1、托管协议的修改程序

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。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后生效。

2、基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十四、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。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点或其网上交易系统更改。

在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1、认购确认书

在基金募集期间开户的，于基金合同生效后的10个工作日内向投资人寄送认购确认书。

2、基金投资人对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。在每季度结束后的15个工作日内向该季度有交易的基金份额持有人以书面形式寄送,年度对账单在每年度结束后15个工作日内对本基金的所有份额持有人以书面形式寄送。

3、其他相关的信息资料

(二) 红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,登记注册机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

(三) 定期定额投资计划

1、定义

本基金的"定期定额投资计划"是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每月扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。投资者在办理本业务的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。

2、办理时间

本业务申请受理时间为开放式基金法定开放日 9:30—15:00

3、办理场所

目前,我公司直销e网金、中国银行、中国建设银行、招商银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、交通银行、平安银行、渤海银行、信达证券、江海证券、东吴证券、德邦证券、国泰君安证券、华福证券、中银国际证券、华宝证券、平安证券、齐鲁证券、光大证券、国信证券、长城证券、兴业证券、海通证券、广发证券、安信证券、华安证券、中信建投、长江证券、中投证券、申银万国证券、恒泰证券、中国银河证券、中信证券、华泰证券、中信金通证券已开通本基金的定期定额投资业务。其中,中国建设银行只接受个人投资者的申请。

本公司新增其他销售机构开办此业务时,将另行公告。

4、申请方式

(1) 凡申请办理本业务的投资者,须先开立本公司开放式基金账户(已开户者除外),具体开户程序应遵循销售机构的相关规定。

(2) 已开立本公司开放式基金账户的投资者,请到销售机构的各营业网点申请办理此

项业务，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定。

5、扣款日期

投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每月固定扣款日期。如果在约定的扣款日前投资者开办定期定额投资业务的申请得到成功确认，则首次扣款日为当月，否则为次月。

6、扣款方式

销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；如因投资者提交变更、解约等申请而使扣款信息与注册登记机构确认的约定信息不符或基金管理人发布暂停定期定额投资业务公告等情况，则此次扣款不成功。投资者需指定一个销售机构认可的资金账户作为每月固定扣款账户。如投资者账户余额不足的，应遵循相关销售机构的规定处理。

7、申购费率

如无另行规定(详细情况请参见各销售机构相关业务公告), 定期定额申购费率及计费方式等同于正常的申购业务。

8、交易确认

每月实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日（T日）的基金份额净值为基准计算申购份额，投资者可自 T+3 工作日起查询本基金定期定额申购确认情况。

9、本业务的变更和终止

（1）投资者变更每月扣款金额、扣款日期、扣款账户等信息，须到原销售网点申请办理业务变更手续，具体办理程序应遵各销售机构的相关规定；

（2）投资者终止本业务，须到销售机构申请办理业务终止手续，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定；

（3）本业务变更和终止的生效日应遵循各销售机构的具体规定。

（四）基金转换

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

（五）在线服务

基金管理人利用自己的网站（www.fsfund.com）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

（六）资讯服务

1、投资人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：021—38924558（未开通 4007 电话地区） 4007005588，该电话可转人工座席。

直销中心电话：021-38505888—301 或 302、38505731、38505732

传真：021-50499663、50499667、50988055

2、互联网站

公司网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

（七）客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十五、其他应披露事项

本报告期内，本基金在指定媒体刊登的公告如下：2012年3月29日刊登了《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金2011年年度报告报告》及《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金2011年年度报告报告(摘要)》、2012年4月23日刊登了《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金2012年第1季度报告》、2012年5月12日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于在“e网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告》、2012年6月26日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告》、2012年6月29日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于在“e网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告》、2012年7月2日刊登了《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金资产净值公告》、2012年7月4日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于公司住所变更的公告》、2012年7月18日刊登了《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金2012年第2季度报告》、2012年8月27日刊登了《华宝兴业

成熟市场动量优选证券投资基金 2012 年半年度报告》及《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）》。

二十六、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和代销机构的办公场所和营业场所。投资人可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十七、备查文件

备查文件包括：

- （一）中国证监会核准华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金募集的文件
- （二）《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》
- （三）《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金托管协议》
- （四）《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

其中，《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》和《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2012 年 10 月 26 日