

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金 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《关于同意华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]956号)的核准,进行募集。基金合同于2008年10月7日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业大盘精选股票型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。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2012年10月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日,数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的,以本次更新的招募说明书为准。

目 录

一、绪 言.....	1
二、释 义.....	2
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	13
五、相关服务机构.....	16
六、基金的募集.....	29
七、基金合同生效.....	30
八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管.....	30
九、与基金管理人管理的其他基金转换.....	37
十、基金的投资.....	42
十一、基金的业绩.....	51
十二、基金财产.....	52
十三、基金资产估值.....	52
十四、基金收益与分配.....	55
十五、基金的费用.....	57
十六、基金税收.....	58
十七、基金的会计与审计.....	58
十八、基金的信息披露.....	59
十九、风险揭示.....	62
二十、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	64
二十一、基金合同的内容摘要.....	66
二十二、基金托管协议内容摘要.....	77
二十三、对基金份额持有人的服务.....	84
二十四、其他应披露事项.....	89
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	90
二十六、备查文件.....	90

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(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》”)、其他有关规定及《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业大盘精选股票型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士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,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释 义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金；
基金合同：	指《华宝兴业大盘精选股票型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；
招募说明书或本招募说明书：	指《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
基金份额发售公告：	指《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金份额发售公告》；
托管协议：	指《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指2011年6月9日由中国证监会公布并于2011年10月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指华宝兴业基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为

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本基金注册登记业务的机构；

投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；

个人投资者：指年满 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；

机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

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

基金份额持有人大会：指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；

基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；

基金合同生效日：指 2008 年 10 月 7 日；

存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

认购：指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

申购：指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；

赎回：指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；

基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；

转托管：	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指基金资产净值除以基金份额余额所得的基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但

不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

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

传真：021-38505777

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，外方股东领先资产管理有限公司持有 49% 的股份。

(二) 主要人员情况

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。曾任北京科技大学经济管理学院（现东凌经济管理学院）教授、院长。现任北京科技大学东凌经济管理学院教授、学术委员会副主席，管理科学研究所所长。

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。曾任加拿大赤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。

4、本基金基金经理

范红兵先生，曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作，于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理。

王智慧先生，曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事证券研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部副总经理，先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务，现任研究部总经理，2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理，2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

冯刚先生，管理学硕士，2008年10月至2010年7月担任本基金基金经理。

5、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》、《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

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。

四、 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

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)、上投摩根全球天然资源股票型、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,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、 相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

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：021-38505888-301 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) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.95599.cn

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 中信银行股份有限公司

注册地址：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

24 小时客户服务热线：95558

网址：bank.ecitic.com

(9) 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

(10) 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

(11) 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市农林下路 83 号

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

客户服务电话：800-830-8003；400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

(12) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

网址：<http://www.cib.com.cn>

客户服务电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

(13) 江苏银行股份有限公司

住所：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

网址：www.jsbchina.cn

客户服务电话：96098，40086-96098

(14) 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

(15) 华夏银行股份有限公司

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

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人: 宫少林

电话: 0755-82943666

联系人: 林生迎

客户服务热线: 4008888111、95565

公司网址: www.newone.com.cn

(22) 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>

(23) 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

(24) 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>

(25) 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

(26) 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>

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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>

(38) 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

(39) 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

(40) 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)

(41) 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>

(42) 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

(43) 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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）东兴证券股份有限公司

公司名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

基金销售联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

公司网站：www.dxzq.net.cn

公司客户服务电话：400-8888-993

（48）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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>

(54) 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

(55) 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：安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：沈钰文

联系电话：(021) 24052000

传真：(021) 54075507

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

六、 基金的募集

本基金经中国证监会证监许可【2008】956 号《关于核准华宝华宝兴业大盘精选股票型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 2008 年 9 月 8 日起，至 2008 年 9 月 26 日止，共募集 490,050,880.11 份基金份额，有效认购户数为 3473 户。

七、 基金合同生效

本基金基金合同于 2008 年 10 月 7 日正式生效。

八、 基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管

（一）申购与赎回的场所

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

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金自 2008 年 12 月 15 日起开始办理日常申购、赎回业务。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

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

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 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，否则，如因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

3、申购与赎回申请的款项支付

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

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

（五）申购与赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销 e 网金申购本基金单笔最低金额为 1,000 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 100 份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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

(六) 申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / [1 + \text{申购费率}]$$

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

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

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财产承担。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。

2、赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

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

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

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

(七) 申购和赎回的费用及其用途

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	0.5%

大于等于 100 万，小于 200 万	1.0%
大于等于 50 万，小于 100 万	1.2%
50 万以下	1.5%

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

2、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	费率
两年以内（含两年）	0.5%
两年—三年（含三年）	0.3%
三年以上	0%

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

4、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，也可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人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关销售机构同意，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。

（八）申购与赎回的注册登记

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

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

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

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

（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，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 2 日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

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

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- （2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- （5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项;
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- (3) 基金连续发生巨额赎回,根据基金合同规定,可以暂停接受赎回申请的情况;
- (4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况;
- (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回,基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束,基金重新开放时,基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一天,基金管理人将于重新开放日,在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体,刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最近一个开放日的基金份额净值。

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

(3) 如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次;当连续暂停时间超过两个月时,可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前三个工作日,在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十一)基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

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

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;

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

非交易过户业务由基金注册登记机构统一办理。办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。无论在上述何种情况下，接受非交易过户的主体必须是合格的投资者。

2、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。

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

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

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

九、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

（二）基金转换受理场所

基金转换受理场所与基金份额申购、赎回申请的受理场所相同。

目前，本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、民生银行、交通银行、招商银行、中信银行、浦发银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、渤海银行、华夏银行已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金、中证 100 指数基金（前端收费模式）间的相互转换。

申银万国证券、国泰君安证券、海通证券、兴业证券、中信建投证券、联合证券、招商证券、光大证券、长江证券、东吴证券、渤海证券、中信证券、平安证券、广发证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东兴证券、德邦证券、华安证券、东北证券、上海证券、方正证券、东海证券已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间、中证 100 指数基金（前端收费模式）的相互转换。

中信金通证券、恒泰证券、中投证券已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间的相互转换。

东吴证券已开通本基金与公司管理的多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间的相互转换。

银河证券、中信万通证券、长城证券、安信证券、华宝证券、中国国际金融公司、齐鲁证券已开通本基金与公司管理的中证 100 指数基金（前端收费模式）间的互相转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、国泰君安证券、海通证券、申银万国证券、光大证券、东兴证券、东

海证券已开通本基金与上证 180 价值 ETF 联接基金之间的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、申银万国证券、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、国信证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、国都证券、东兴证券、东北证券、德邦证券、上海证券、方正证券已开通本基金与新兴产业基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信金通证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、申银万国证券、海通证券、光大证券、中信建投证券、广发证券、中信证券、长江证券、华福证券、国信证券、中国银河证券、齐鲁证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中国国际金融公司、中信金通证券已开通本基金与上证 180 成长 ETF 联接基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中信银行、平安银行、渤海银行、中国民生银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、国都证券、德邦证券、上海证券、中航证券、招商证券、东北证券、西南证券、华福证券、中信建投证券、江海证券、国元证

券、华安证券、中银国际证券、民生证券、中国国际金融公司、中信证券（浙江）、东海证券已开通本基金与华宝兴业医药生物基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、平安银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融、中信证券（浙江）、中信万通证券、华泰证券、中银国际证券、华福证券、东北证券股份、招商证券、西南证券已开通本基金与短融 50 基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融、兴业证券、中银国际证券、华福证券、东北证券、安信证券、西南证券、东兴证券已开通本基金与资源优选基金的转换业务。

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销售的本公司管理的基金。其他销售机构基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

（三）基金转换受理时间

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。

（四）基金转换费用

本基金与公司管理的其他基金转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25% 归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申

购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

（五）基金转换公式

1、基金转换公式为：

转出费用=转出份额*转出基金单位净值*转出基金赎回费率

转出总金额=转出份额*转出基金单位净值

净转出金额=转出总金额-转出费用

净转入金额=净转出金额/（1+补差费率）

（补差费率=转出基金申购费率与转入基金申购费率差）

转换补差费用=净转出金额-净转入金额

转入份额=净转入金额/转入基金单位净值

转入份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。

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

（六）不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。

（七）基金转换的程序

1、基金转换的申请方式

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

2、基金转换申请的确认

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

基金份额持有人申请转换时，基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先转换，后确认的份额后转换。

（八）基金转换的数额限制

基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位。从本基金、宝康系列基金、多策略增长基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券、中证100指数基金（前端收费模式）、上证180价值ETF联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证180成长ETF联接基金、医药生物基金、短融50基金、资源优选基金转出，单笔转换申请份额不得低于100份；从现金宝货币市场基金转出，单笔转

换申请份额不得低于 200 份。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构（网点）保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，注册登记机构不作强制赎回处理。

（九）基金转换的注册登记

1、基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间内可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、基金注册登记机构在 T+1 日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

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

（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

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

- （1） 不可抗力；
- （2） 货币市场工具主要交易场所在交易时间非正常停市；
- （3） 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；
- （4） 暂停估值；
- （5） 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报中国证监会备案。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。

如果发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金收益情况。

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

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，

重新开放基金转换时,基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告,并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

十、 基金的投资

(一) 本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

在控制风险的前提下,争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等其他品种,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

(1) 资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金的股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%,其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%,权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%,资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%,债券及现金投资比例为基金资产净值的 5%-40%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%)。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。

(2) 股票投资策略

本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景,注重价值挖掘,精选个股。

1) 定量与定性相结合的个股精选策略

本基金的股票池主要包括大盘股。

在股票池中先用 7 个指标进行定量分析,这 7 个定量指标分别为:

成长指标: --预测未来两年 EPS 复合增长率

价值指标: --预测 P/E --预测 P/B

 --预测 P/CF --预测 P/S

盈利指标：--过去三年平均 ROE

--过去三年平均 ROIC

筛选出排名靠前的股票形成初选股票池。

对初选股票池中的股票，进行案头研究和实地调研，深入研究企业的基本面和长期发展前景，精选符合以下一条或数条定性判断标准的股票，形成备选股票池：

明显的规模经济和范围经济；

行业地位突出，强大的核心竞争力；

良好的管理能力和长远规划；

盈利能力强且注重股东回报和投资者关系；

公司治理完善、信息披露规范等。

2) 行业调整策略

通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。

(3) 债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理，以追求稳定收益和充分流动性的投资目标。

大资产配置主要是通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对货币资产和债券类资产进行选择配置，同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券。

品种选择上，主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析，筛选出流动性良好，成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括：

1) 久期灵活管理：在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上，确定债券组合久期目标范围，在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短，以获取市场超额收益。

2) 曲线合理定价：按照市场各品种实际成交情况，得出合理收益率曲线，使用该曲线对备选品种进行合理定价，确定其公允价格，在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3) 曲线下滑策略：对收益率曲线形态进行分析，并预测其未来形态变化，选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作，买入曲线上端品种，等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑，从而得到超额下滑利润。

(4) 其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据，捕捉市场机会，提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略，可转换债券采用自上而下的两层次配置策略，在对宏观经济、行业分析的基础上，选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益，并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外，本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

4、业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

沪深 300 指数是第一个覆盖了沪深两市的交易所权威指数，具有市值覆盖率高、行业代表性强、流动性好等特点。

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程序后，可选用新的比较基准，并将及时公告。

5、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

(二) 投资程序

1、投资决策委员会负责投资决策

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。

2、金融工程部负责跟踪数量分析模型

金融工程部实时跟踪数量分析模型，定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。

3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告,通过走访政府决策部门和研究部门,研究经济形势、经济政策(货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等)、重大技术发明等,撰写宏观研究报告,就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名,以排名靠前的股票为主要研究对象,考察上市公司的基本面和长期发展前景,预测上市公司未来2—3年的经营情况,选择重点上市公司进行调研,撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告,对个股买卖提出具体建议。

4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展,结合量化分析等工具对股市做出判断,提出投资组合的资产配置比例建议,同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告,形成投资计划提交投资决策委员会,并根据投资决策委员会的决策,具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后,基金经理向交易部下达具体的投资指令,交易员根据投资决定书执行指令。

5、绩效评估

主要包括四项核心功能:风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献,由绩效评估人员利用相关工具评估。

6、内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、内控审计风险管理部负责内控制度的制定,并检查执行情况。

(三) 投资限制与禁止行为

1、组合限制

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

- (1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
- (2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
- (3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
- (4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
- (5)本基金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%;

(6) 本基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的 60%—95%，权证占 0%—3%，资产支持证券占 0%-20%，债券及现金占 5%-40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）；

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易；

(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）的资产支持证券，在持有期间如果其信用等级下降、不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 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；

(14) 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%；

(15) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(16) 法律法规或监管部门取消上述限制，基金管理人在履行适当程序后，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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于因基金规模短期内快速增长而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人可将调整时限从十个交易日延长到三个月。基金规模快速增长主要是指基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形。基金发生上述需延长建仓期限情形的，基金管理人应同基金托管人协商一致并及时向中国证监会基金监管部书面报告，说明上述情况出现的原因及解决方案。

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。

2、禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

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

(四) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(五) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

(六) 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	458,400,615.48	77.65
	其中：股票	458,400,615.48	77.65
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	130,693,263.33	22.14
6	其他各项资产	1,239,499.88	0.21
7	合计	590,333,378.69	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,240,036.00	2.25
B	采掘业	17,915,139.18	3.05
C	制造业	241,084,548.64	41.04
C0	食品、饮料	52,004,878.24	8.85
C1	纺织、服装、皮毛	15,983,809.89	2.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,244,997.25	1.40
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	34,877,939.40	5.94
C7	机械、设备、仪表	103,122,038.80	17.56
C8	医药、生物制品	26,850,885.06	4.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,976,087.66	0.68
E	建筑业	8,740,000.00	1.49
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	20,492,265.62	3.49
H	批发和零售贸易	7,800,000.00	1.33
I	金融、保险业	71,208,242.62	12.12
J	房地产业	65,288,164.46	11.11
K	社会服务业	8,656,131.30	1.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	458,400,615.48	78.04

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300185	通裕重工	5,580,000	29,127,600.00	4.96
2	600030	中信证券	1,599,970	20,207,621.10	3.44
3	000002	万科A	2,200,226	19,604,013.66	3.34

4	000895	双汇发展	299,941	18,560,349.08	3.16
5	600519	贵州茅台	70,000	16,740,500.00	2.85
6	000858	五粮液	509,891	16,704,029.16	2.84
7	600048	保利地产	1,300,000	14,742,000.00	2.51
8	600837	海通证券	1,500,000	14,445,000.00	2.46
9	000800	一汽轿车	1,300,000	14,118,000.00	2.40
10	002299	圣农发展	916,900	13,240,036.00	2.25

4、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。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，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) 本基金股票投资的主要对象是大盘股，基金管理人建立有基金股票备选库。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	118,118.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,855.33
5	应收申购款	1,097,526.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,239,499.88

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
2008/10/07-2008/12/31	0.98%	0.21%	-10.74%	2.39%	11.72%	-2.18%
2009/01/01-2009/12/31	91.29%	1.71%	73.60%	1.64%	17.69%	0.07%
2010/01/01-2010/12/31	-3.18%	1.46%	-9.12%	1.26%	5.94%	0.20%
2011/01/01-2011/12/31	-30.49%	1.14%	-19.67%	1.04%	-10.82%	0.10%
2012/01/01-2012/06/30	7.85%	1.21%	4.47%	1.06%	3.38%	0.15%
2008/10/07-2012/06/30	40.21%	1.38%	18.18%	1.41%	22.03%	-0.03%

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：

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 10 月 7 日至 2012 年 6 月 30 日)

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 2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

十二、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持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
- 4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产估值

（一）估值目的

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

（二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票的估值

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

日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

（3）有明确锁定期股票的估值

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

2、固定收益证券的估值办法

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

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值：

(1) 配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权, 类同权证处理方式的, 采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值, 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下, 按成本估值; 因持有股票而享有的配股权, 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下, 基金管理人采用上述 1-4 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, 如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(五) 估值程序

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

(六) 暂停估值的情形

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

(七) 基金份额净值的确认

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

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。

（八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

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

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 5 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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

十四、基金收益与分配

（一）收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收入。

2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3、基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

（二）收益分配原则

1、本基金收益分配方式

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（将现金红利按红利发放日前一日的该基金份额净值自动转为基金份额的方式），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。

- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；
- 7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 10%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）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。

（四）收益分配方案的确定与公告

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

（五）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值转为基金份额。

十五、基金的费用

（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；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （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）基金合同生效以后与本基金相关的会计师费和律师费；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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）上述“1、基金费用的种类”中（3）到（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

5、基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管”中的“（六）申购份额与赎回金额的计算方式”和“（七）申购和赎回的价格、费用及用途”中的相关规定。

本基金与其他基金间的转换费的费率水平和计算方式请详见本招募说明书“九、与基金管理人管理的其他基金转换”一章中的相关规定。

十六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十七、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会

会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、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 2 日内公告。

十八、基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

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

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

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

（五）定期报告

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

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

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

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（六）临时报告与公告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

（七）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。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

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

十九、风险揭示

（一）投资于本基金的风险

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，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。

2、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人有权接受投资人的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行股票买卖。然而，市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的股票，其流动性都各不相同。一般来说，股市上涨期，市场流动性较高；股市下跌期，市场流动性低；大盘蓝筹股流动性高，小盘垃圾股流动性较低。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出股票，或者必须付出较高成本才能买进或卖出股票，这样，就在两个方面产生了风险：

（1）当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进股票，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

（2）当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出股票，从而影响本基金的投资业绩。

3、本基金的特有风险

本基金作为股票型基金，在投资管理中会至少维持 60% 的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

本基金属于大盘股票基金，存在投资风格风险，即集中投资于大盘股的业绩表现不一定领先于市场平均水平。

（2）权证投资风险

另外，本基金可以投资权证，权证是金融衍生品的一种，具有高杠杆、高风险、高收益的特征，风险较大。

4、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。

5、操作或技术风险

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

6、合规性风险

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

7、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

（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。

二十、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合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于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基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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

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

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

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

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

员。

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

3、清算程序

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

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人权利及义务

1、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- 5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- 6) 在合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- 10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- 11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- 12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- 13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- 15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定

有关费率；

16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

(2) 基金管理人的义务

1) 依法募集基金，办理或者委托经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、分别记账，进行证券投资；

6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

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

8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

9) 依法接受基金托管人的监督；

10) 编制中期和年度基金报告；

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

12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

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

15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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

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

- 19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

2、基金托管人的权利与义务

(1) 基金托管人的权利

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

(2) 基金托管人的义务

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

规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

12) 建立并保存基金份额持有人名册；

13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利和义务

(1) 基金份额持有人权利

1) 分享基金财产收益；

2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7) 监督基金管理人的投资运作；

8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

(2) 基金份额持有人义务

1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

5) 执行基金份额持有人大会的决议;

6) 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;

7) 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或其合法的代理人组成。

2、 有以下情形之一时, 应召开基金份额持有人大会:

(1) 终止基金合同;

(2) 转换基金运作方式;

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

(4) 更换基金管理人、基金托管人;

(5) 变更基金类别;

(6) 变更基金投资目标、范围或策略;

(7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序;

(8) 本基金与其他基金合并;

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

(10) 法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、 有以下情形之一的, 不需召开基金份额持有人大会:

(1) 调低基金管理费率、基金托管费率;

(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、赎回费率或收费方式;

(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) 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他情形。

4、 召集方式

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

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管

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

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

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

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

(4)代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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

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

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 日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (5) 权益登记日；

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

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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

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

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、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。

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

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

5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

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

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所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

2) 一般决议

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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

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

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

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

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

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金管理人或基金托管人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

10、 生效与公告

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

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

有人大会的决定。

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

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

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) 基金合同的变更和终止

1、基金合同的变更

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

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。

但如因相应的法律法规发生变动并属于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基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的, 可不经基金份额持有人大会决议, 而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布, 并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的, 基金合同应当终止:

(1) 基金份额持有人大会决定终止;

(2) 因重大违法、违规行为, 被中国证监会责令终止的;

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

(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

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

(四) 争议解决方式

基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可通过友好协商解决, 但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的, 则任何

一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

除争议所涉内容之外,基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

(五) 基金合同的存放和获得方式

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登载在各自公司网站上。

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。投资者也可在支付一定工本费后获得基金合同复印件或复制件,但应以基金合同正本为准。

二十二、基金托管协议内容摘要

(一) 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
注册资本： 1.5 亿元人民币
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
营业期限： 持续经营

2、基金托管人

名称： 中国银行股份有限公司
住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人： 肖钢
经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

企业类型： 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

(二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

(1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督；基金管理人应将拟投资的股票库、债券库

等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

(2) 对基金投融资比例进行监督；

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

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

(5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

1) 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

2) 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

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

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

(7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

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

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、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，并及时向中国证监会报告。

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

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

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

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

（四）基金财产保管

1、基金财产保管的原则

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

2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

- （1） 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集

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

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

3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

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

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

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

5、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

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

5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

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

(2) 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资

所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

6、债券托管专户的开设和管理

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

7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。

8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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

(五) 基金资产净值计算与复核

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

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

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

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以

及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

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

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

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

（六）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。

（七）争议解决方式

1、协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

3、除争议所涉的内容之外，协议的当事人仍应履行协议的其他规定。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更

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

2、托管协议的终止

发生以下情况，托管协议应当终止：

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

二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人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、开户确认书

在基金募集期间开户的，于基金合同生效后的十个工作日内向投资人寄送开户确认书。存续期间，在每个季度结束后15个工作日内向投资人寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金的基金份额持有人除外)。

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或电子文件形式寄送，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或电子文件形式寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金的基金份额持有人除外)。

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，本公司直销 e 网金、中国银行、招商银行、中国工商银行、中国建设银行、民生

银行、交通银行、中信银行、农业银行、平安银行、浦发银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、渤海银行、华夏银行、国泰君安证券、中信建投证券、海通证券、招商证券、银河证券、东吴证券、平安证券、安信证券、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、江海证券、光大证券、国信证券、东北证券、华安证券、德邦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、扣款金额

投资者应与销售机构就申请开办本业务约定每月固定扣款（申购）金额。最低扣款金额应遵循代销机构的规定。投资人在本公司直销e网金申请办理本业务的每期扣款金额最低不少于人民币200元（含申购费）。

（四）基金转换

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、民生银行、交通银行、招商银行、中信银行、浦发银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、渤海银行、华夏银行已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金、中证100指数基金（前端）间的相互转换。

申银万国证券、国泰君安证券、海通证券、兴业证券、中信建投证券、联合证券、招商证券、光大证券、长江证券、东吴证券、渤海证券、中信证券、平安证券、广发证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东兴证券、德邦证券、华安证券、东北证券、上海证券、方正证券、东海证券已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间、中证100指数基金（前端）的相互转换。

中信金通证券、恒泰证券、中投证券已开通本基金与公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间的相互转换。

东吴证券已开通本基金与公司管理的多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、增强收益债券基金间的相互转换。

银河证券、中信万通证券、长城证券、安信证券、华宝证券、中国国际金融公司、齐鲁

证券已开通本基金与公司管理的中证 100 指数基金（前端）间的互相转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、国泰君安证券、海通证券、申银万国证券、光大证券、东兴证券、东海证券已开通本基金与上证 180 价值 ETF 联接基金之间的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、申银万国证券、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、国信证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、国都证券、东兴证券、东北证券、德邦证券、上海证券、方正证券已开通本基金与新兴产业基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信金通证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、申银万国证券、海通证券、光大证券、中信建投证券、广发证券、中信证券、长江证券、华福证券、国信证券、中国银河证券、齐鲁证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中国国际金融公司、中信金通证券已开通本基金与上证 180 成长 ETF 联接基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中信银行、平安银行、渤海银行、中国民生银行、国泰君安证券、光大证券、海

通证券、中国银河证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、国都证券、德邦证券、上海证券、中航证券、招商证券、东北证券、西南证券、华福证券、中信建投证券、江海证券、国元证券、华安证券、中银国际证券、民生证券、中国国际金融公司、中信证券（浙江）、东海证券已本基金与华宝兴业医药生物基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、平安银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融、中信证券（浙江）、中信万通证券、华泰证券、中银国际证券、华福证券、东北证券股份、招商证券、西南证券已开通本基金与短融 50 基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融、兴业证券、中银国际证券、华福证券、东北证券、安信证券、西南证券、东兴证券已开通本基金与资源优选基金的转换业务。

其他代销机构的办理时间将另行公告。

（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：4007005588、021-38924558，电话可转人工座席。

直销中心电话：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。

二十四、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30日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告》、2012年3月30日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于参加工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告》、2012年4月23日刊登了《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金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28日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于参加江苏银行网上银行基金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1日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告》、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《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金2012年第2季度报告》、2012年8月27日刊登了《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金2012年半年度报告》及《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金2012年半年度报告（摘要）》。

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资人查阅。

- (一) 中国证监会核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《华宝兴业大盘精选股票型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

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11月20日