

# 华安大中华升级股票型证券投资基金 更新的招募说明书

(2012年第2号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一二年十二月

## 重要提示

华安大中华升级股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2011年3月7日《关于核准华安大中华升级股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]328号）核准。本基金基金合同自2011年5月17日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于海外证券市场，基金净值会因为所投资证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，从而获取基金投资收益，并承担相应的投资风险。本基金投资中的风险主要：（1）市场风险，本基金主要投资于海外证券市场，证券市场的价格可能会因为不同国家和地区政治环境、宏观和微观经济因素、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、信用风险、大宗交易风险、再投资风险、购买力风险、上市公司经营风险、国别市场风险、汇率风险等；（2）管理风险，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平；（3）流动性风险，包括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，证券投资中个券和个股的流动性风险等；（4）其他风险。

投资有风险，投资者在认购（或申购）基金前请认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2012年11月17日，有关财务数据截止日为2012年9月30

日，净值表现截止日为2012年6月30日。

## 目 录

一、绪言 .....	1-1
二、释义 .....	2-1
三、风险揭示.....	3-1
四、基金的投资.....	4-1
五、基金的业绩.....	5-1
六、基金管理人.....	6-1
七、基金的募集.....	7-1
八、基金合同的生效.....	8-1
九、基金份额的申购和赎回.....	9-1
十、基金的费用与税收.....	10-1
十一、基金的财产.....	11-1
十二、基金资产的估值.....	12-1
十三、基金的收益与分配.....	13-1
十四、基金的会计与审计.....	14-1
十五、基金的信息披露.....	15-1
十六、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	16-1
十七、基金托管人.....	17-1
十八、境外托管人.....	18-1
十九、相关服务机构.....	19-1
二十、基金合同的内容摘要.....	20-1
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	21-1
二十二、对基金投资人的服务.....	22-1
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	23-1

二十四、其他应披露事项.....	24-1
二十五、备查文件.....	25-3
附件一：基金合同内容摘要.....	26-1
附件二：基金托管协议内容摘要.....	27-1

## 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》）、《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》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称《通知》）和其他相关法律法规的规定以及《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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，并按照有关法律法规、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,下列词语具有如下含义:

基金或本基金:	指华安大中华升级股票型证券投资基金;
本招募说明书、《招募说明书》:	指《华安大中华升级股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新;
《基金合同》	指《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充;
托管协议:	指《华安大中华升级股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
发售公告:	指《华安大中华升级股票型证券投资基金发售公告》;
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;
外管局:	指国家外汇管理局;
《证券法》:	指《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订;
《合同法》:	指《中华人民共和国合同法》及颁布机关对其不时作出的修订;
《基金法》:	指《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;
元:	如无特指,指人民币;
基金合同当事人:	指受本《基金合同》约束,根据本《基金合同》享受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;
基金管理人:	指华安基金管理有限公司;

- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 境外托管人：指基金托管人委托的、负责基金境外财产的保管、存管、清算等业务的金融机构；
- 境外投资顾问：是指符合《试行办法》规定的条件，根据合同为基金管理人境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的境外金融机构，基金管理人有权根据基金运作情况选择、聘请、增补、更换或撤销境外投资顾问；
- 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安基金管理有限公司或接受华安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、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份额的投资者；
- 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三个月；
- 基金合同生效日：基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续，获得中国证监会书面确认之日；
- 存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；



- 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 开放日：指销售机构为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- 认购：指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人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：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：指基金管理人或其委托的第三方机构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：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、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或其它媒体；
- 基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额

的变动及结余情况的账户；

- T 日：指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日；
- T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包括 T 日）；
- 基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额；
- 基金资产总值：指基金拥有的各类证券或票据价值以及应计利息、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和；
- 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值：指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后得出的基金份额资产净值；
- 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：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、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事件。

### 三、风险揭示

#### （一）本基金的特殊风险

本基金主要通过投资于香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场上市的大中华地区企业发行的股票或存托凭证，分享大中华区域经济发展增长的成果。由于大中华地区企业大多具有较高的成长性，其成长能力可能会带来较高预期收益，但同时这类企业也会较容易受到经济周期、产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构等因素的影响，可能会有较大的市场波动性。

本基金也将受到不同国家或地区税务政策、汇率、交易规则、结算托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使本基金资产面临潜在风险。

此外，由于各个国家或地区适用不同法律、法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为在部分国家或地区受到限制，从而对投资收益产生直接或间接的影响。例如台湾市场，目前对于内地QDII产品在市场进入、投资额度、可投资对象、托管结算、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

本基金将密切关注各主要投资目的地的政治、经济、产业政策、投资限制的变化，适时调整投资策略，以应对此类风险的变化。

#### （二）市场风险

本基金的市场风险来源于基金股票资产、债券资产市场价格的波动，以及在运用衍生金融工具进行组合避险或有效管理的情况下的衍生金融工具市场波动风险。影响市场价格波动的因素包括：

##### 1、海外市场风险

由于本基金主要投资于海外证券市场上市的大中华地区企业发行的股票或存托凭证，因此不同国家和地区处于不同产业景气循环周期位置，将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场可能对于特定事件、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国内A股证券市场有诸多不同。并且，美国、英国、香港等证券市场对每日证券交易价格没有涨跌幅上下限的规定，因此每日价格涨跌空间相对较大。上述因素可能会带来市场的急剧波动，从而增加投资风险。

##### 2、汇率风险

由于本基金产品是以人民币销售与结算，投资于以港币、美元等币种报价的金融工具，因此投资者面临汇率风险。也就是说，该基金投资在境外取得的港币、美元等计价的投资收益，可能会因为人民币升值而被部分侵蚀。外币对人民币的汇率大幅波动也会加大基金净值波动的幅度。

### 3、税务风险

在投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。各国、地区的税收法律法规的规定可能发生变化，或者进行具有追溯力的修订，所以本基金可能须向该等国家或地区缴纳基金销售、估值或者出售投资当日并未预计到的额外税项。

### 4、政策风险

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。

### 5、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家或地区经济、各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到证券市场走势。

### 6、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。

### 7、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收益率的变化都会影响债券的价格，从而影响到基金资产。

### 8、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。

### 9、再投资风险

再投资获得的收益有时又被称作利息的利息，这一收益取决于再投资时的利率水平和再投资的策略。因未来市场利率的变化而引起给定投资策略下再投资收益率的不确定性为再投

资风险。

#### 10、购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

#### 11、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术更新、新产品研究开发、高级专业人才流动等风险。如果收益资产所投资的上市公司基本面或发展前景发生变化，其所发行的股票价格下跌，或者能够用于分配的利润减少，使收益资产预期的投资收益下降。虽然收益资产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

### **（三）管理风险**

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。例如资产配置、类属配置因市场原因不能符合基金合同的要求，不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### **（四）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；证券投资中个券和个股的流动性风险等。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，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股或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股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或者买入卖出行为对个股或个券价格产生比较大的影响，增加个股或个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌或涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

### **（五）其他风险**

#### 1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本基

金也可能由于向投资人分红而面临现金不足的风险。

## 2、技术风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况,可能导致基金日常的赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## 3、大额赎回风险

本基金为开放式基金,基金规模将随着投资人对基金单位的赎回而不断变化,若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响。

## 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回,并导致基金管理人的现金支付出现困难,基金投资人在赎回基金份额时,可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

## 5、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险,以及证券市场、基金管理人可能因不可抗力无法正常工作,从而影响基金的正常申购和赎回。

## 6、交易结算风险

在基金的投资交易中,当交易对手方无法履行对一位或多位交易对手方的支付义务时,基金有蒙受损失的可能性。

## 7、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或错误,通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管等相关业务处理中,由于客观原因,非主观故意造成行为过失,从而对基金收益造成影响的风险。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。

### （二）投资范围

本基金投资范围为大中华地区企业，包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场（如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场）发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于东亚及东盟区域市场，包括韩国、印尼、马来西亚、菲律宾、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等；投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金所指的大中华地区企业是企业注册地或企业主营业务收入主要来源地属于中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区区域范畴内。

本基金的投资组合为：股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 85% 的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业，不高于 15% 的股票资产投资于东亚及东盟区域市场；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

### （三）投资理念

中国地区的经济升级，包括产业结构升级、消费升级和技术升级的三大趋势，不仅给中国经济增长引擎注入了强大的动力，而且也将带动中国周边地区，尤其是大中华地区的经济增长与繁荣。

本基金将通过深入的基本面研究，在广阔的市场范围内寻找受益于中国地区经济升级，具备估值优势和长期增长潜力的投资品种，合理控制投资风险，以获取基金资产中长期稳定增值。

#### （四）投资策略

##### 1、资产配置策略

本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，利用数量模型工具，分析和比较股票、债券等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。同时，本基金将定期，或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整，以保持基金资产配置的有效性。

##### 2、股票投资策略

本基金以价值和成长投资理念为导向，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。本基金将以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索。通过对于经济结构调整的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标。同时通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究，考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘受益于中国地区经济升级，并具备中长期持续增长或阶段性高速增长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。

对于中国大陆地区企业，本基金挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题。本基金中期重点关注以下几类行业：

**战略性新兴产业：**国家中长期科学和技术发展规划纲要把建设创新型国家作为战略目标，把可持续发展作为战略方向，把争夺经济科技制高点作为战略重点。在这一规划下，战略性新兴产业将逐步成为经济社会发展的主导力量。本基金认为，战略性新兴产业必须掌握关键核心技术，具有市场需求前景，具备资源能耗低、带动系数大、就业机会多、综合效益好的特征。在选择战略性新兴产业时，将着重考虑以下几个因素：一是产品要有稳定并有发展前景的市场需求；二是要有良好的经济技术效益；三是要能带动一批相关产业的兴起。本基金根据国民经济和社会发展规划、产业调整与振兴规划以及区域发展战略等，确定节能环保、信息技术、新材料和生物医药等行业为中长期的战略性新兴产业。未来将根据经济社会的发展和政策的演变适当调整战略性新兴产业的范畴。

**消费升级行业：**当前在经济增长的三驾马车中，消费是最为稳定且持续增长的因素。随着我国居民收入水平提高，消费升级趋势越来越明显，导致消费升级受益行业公司业绩持续稳定增长。本基金将对影响居民收入水平及消费结构的因素以及消费结构的变化趋势进行跟



踪分析，发掘不同时期的消费升级主题，在不同子行业间进行积极的轮换，不断优化股票资产结构。

**传统行业中的技术升级：**传统行业中的技术升级也是本基金重点关注的投资主题。创新投入和新科技的应用将为传统行业注入新的活力，带动技术升级和盈利模式的创新。本基金在投资传统行业时，将通过技术应用前景、市场需求和经济效益三方面论证企业发展战略和市场推进措施，挖掘技术升级带来的投资机会。

对于香港与台湾地区企业，本基金中期在行业选择方面重点关注：一是中国大陆的升级趋势给当地行业带来的新机遇，二是当地部分产业配合中国大陆的升级趋势而产生的自发性的升级。包括不限于：

**金融行业：**CEPA 与 ECFA 的签定推进了两岸三地金融一体化。随着中国大陆内部金融深化与金融创新进程不断推进，对金融服务的需求将持续快速增长，从而给香港与台湾的金融业带来新的发展机遇。

**旅游行业：**随着中国大陆的消费居民的可支配收入持续增长，升级不断提升，两岸三地的旅游业的开放，将带动大量大陆居民出境旅游，从而带动当地旅游业以及相关的服务业的迅速增长。

**新兴专业服务行业：**中国大陆的消费升级以及产业升级会产生大量对新型服务业的需求，包括法律、税务、咨询、教育培训、医疗、家政等等，香港与台湾在这些领域的发展大大领先于中国大陆地区，因此，随着大陆地区对这类行业的需求增长，也为香港/台湾的此类相关行业带来新的发展机遇。

**信息技术行业：**随着中国大陆信息化水平的不断提高，对新兴信息技术产品的需求不断增长，台湾的信息技术产业与电子制造业将成为中国大陆重要的合作对象，配合台湾自身的产业升级，未来将有较大的发展空间。

本基金从定量及定性两方面对上市公司进行分析筛选，并通过估值模型精选出投入产出效率得到提升和经营效率得到提高的优势企业进行重点投资。

#### ① 定量分析

本基金在选择个股时充分利用上市公司的财务数据和市场数据，从上市公司的盈利能力、成长能力、运营能力、负债水平等各个方面进行量化筛选。本基金采用的量化指标主要包括以下几类：

**盈利能力指标：**主要包括净资产收益率、主营业务利润率、总资产收益率、内部收益率等；

成长能力指标：主要包括长期主营业务收入增长率、长期利润增长率等；

运营能力指标：主要包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等；

负债水平指标：主要包括资产负债率、流动比率、速动比率等。

## ② 定性分析

产业链分工中占据高端环节或具有产业升级潜力；

从落后技术向高新技术转化，从低附加值向高附加值转化，从制造型向创造型转化，从而节约资源、减少消耗、降低成本、减少污染；

良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层；

财务透明，资产质量及财务状况较好，良好的历史盈利记录；

行业集中度及行业地位，具备独特的核心竞争优势和定价能力；

规模效应明显；

具备中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力。

此外，根据公司业绩的长期增长趋势以及同类企业的平均估值水平，应用估值模型选择价值被市场显著低估的企业进行投资。采用的估值模型包括资产重置价格、市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、企业价值倍数（EV/EBITDA）、现金流贴现法（DCF）等。

## 3、固定收益投资策略

本基金管理人会对宏观经济运行趋势及财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。

主要的债券投资策略是：久期调整策略、收益率曲线策略、债券类属配置策略、骑乘策略、信用利差策略等。具体如下：

### ① 久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

### ② 收益率曲线策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### ③ 债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对

低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。

④ 骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况(通常是收益率曲线短端的1-3年)，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着基金持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

⑤ 信用利差策略

企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响，相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动，另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

4、金融衍生品投资策略

本基金参与衍生工具交易的主要目的是组合避险和有效管理。如通过选择恰当的金融衍生品降低因市场风险大幅增加给投资组合带来的不利影响；利用金融衍生品交易成本低、流动性好等特点，有效帮助投资组合及时调整仓位，提高投资组合的运作效率等。

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可通过证券借贷交易和回购交易等投资增加收益。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新招募说明书中公告。

**(五) 业绩比较基准**

本基金业绩比较基准是MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

MSCI 金龙指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪大中华区域内可投资股票的全球性投资指数。在MSCI 金龙指数的体系中，包括价格指数(Price Index)、总收益指数(Gross total return)和净总收益指数(Net total return)。考虑到海外股票的分红次数多、比例高，以及本基金在一些主要投资市场需缴纳一定的预扣税(Withholding Tax)，我们选择将MSCI 金龙净总收益指数作为业绩比较基准。该指数将样本股分红计入指数收益，同时扣除了分红的预扣税，因此能够较好地体现本基金的收益特征。与业绩比较基准比较时，我们将采取相同的计价货币，以准确的体现基金收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用

于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，本基金可以变更业绩比较基准并及时公告。

## （六）风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险品种。

## （七）投资决策依据和决策程序

### 1、决策依据

（1）依据国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定，依法决策是本基金进行投资的前提；

（2）全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况，微观经济运行环境和证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础；

（3）依据投资对象收益和风险的配比关系，在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障；

（4）宏观研究员、策略研究员、股票研究员和数量研究员各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### 2、决策程序

#### （1）决策机制

本基金实行投资决策委员会下的基金经理负责制。投资决策委员会的主要职责是确定基金大类资产的配置策略，以及重大投资方案。基金经理的主要职责是在投资决策委员会批准的大类资产配置范围内构建和调整投资组合。基金经理负责下达投资指令。集中交易部合法、合规地执行交易指令。

#### （2）资产配置阶段

基金经理在研究平台的支持下，对不同类别的大类资产的收益风险状况作出判断。宏观研究员提供宏观经济分析，策略研究员提供策略建议，股票研究员提供行业和个股配置建议，数量研究员结合本基金的产品定位和风险控制要求提供资产配置的定量分析。基金经理结合自己的分析判断和研究员的投资建议，根据合同规定的投资目标、投资理念和投资范围拟定大类资产的配置方案，向投资决策委员会提交投资策略报告。投资决策委员会审议投资策略报告，并做出投资决议。

### (3) 组合构建阶段

研究员负责构建股票的备选库。基金经理在其中选择投资品种，构造具体的投资组合及操作方案，并决定交易的数量和时机。

### (4) 交易执行阶段

由集中交易部负责投资指令的操作和执行。集中交易部合法、合规地执行交易指令，对交易过程中出现的任何情况，负有监控、处置的职责。集中交易部确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理及时反馈。

### (5) 风险评估和绩效分析

风险管理部定期和不定期地对基金组合进行风险评估和绩效分析并提交报告。风险评估报告帮助投资决策委员会和基金经理了解投资组合承受的风险水平和风险的来源。绩效分析报告帮助分析既定的投资策略是否成功，以及组合收益来源是否是依靠实现既定策略获得。风险管理部定期向投资决策委员会提交风险评估和绩效分析报告，并及时反馈结果给基金经理。对重大的风险事项可报告风险控制委员会。

投资决策委员会在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要调整上述投资决策程序。

如果聘请、更换境外投资顾问，基金管理人有权将在遵循上述投资策略的前提下，对其投资决策程序进行适当调整，无需召开基金份额持有人大会。

## (八) 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资产净值的 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、境外资产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、境外资产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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

### （九）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

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

2、基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

3、基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

4、基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。

上述投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

5、基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

上述“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。

6、本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

7、同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份

额的 20%。

8、为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

#### **(十) 金融衍生品投资**

1、本基金投资衍生品仅限于投资组合避险或有效管理，不用于投机或放大交易，同时严格遵守下列规定：

(1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

(2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

#### **2、衍生品投资流程及风险管理策略**

(1) 风险管理部根据基金状况、市场状况以及不同衍生品的风险状况，确定可投资的衍生品种类，并对于各可交易品种，设立风险监控指标，包括合约数量的限额、止损点、VAR 值等；

(2) 基金经理在交易限额内进行衍生品投资并做动态调整；

(3) 风险管理部实时监控衍生品交易情况，对风险指标进行动态预测与监管，运用 VAR 模型计算每日各衍生品的风险价值，并加总获得基金总体衍生品投资的风险值，严禁按相关性对不同方向的仓位进行抵消，一旦发现风险事件及时通知基金经理，并向公司高管汇报；

(4) 交易系统内设预警装置，接近交易限额即自动预警；

(5) 一旦价格触及止损点，风险管理部立即通报基金经理，并有权强制平仓，避免出现严重的风险事件；

(6) 风险管理部在会计年度结束后 60 个工作日内基金衍生品头寸及风险分析年度报告，并报证监会；

(7) 合规监察稽核部建立有效的内部稽核制度，对内部控制的充分性和有效性进行独立检查与评价。

**(十一) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：**

1、所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

(1) 现金；

(2) 存款证明；

(3) 商业票据；

(4) 政府债券；

(5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

**(十二) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：**

1、所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市



值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

**（十三）基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。本项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金、集合计划总资产。**

**（十四）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。**

#### **（十五）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。

#### **（十六）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**

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、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，保护基金份额持有人的利益。

### （十七）基金的融资

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融资。

### （十八）基金的融券政策

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融券。

### （十九）代理投票

1、基金管理人作为基金投资者的受托人，将为基金份额持有人的利益行使本基金所持有股票的投票权。在投票时，基金管理人将本着投资者利益最大化的原则，按照增加股东利益、提高股东发言权的原则进行投票。

2、基金管理人将保留代理投票的文件至少三年以上。

3、基金管理人可委托境外投资顾问或境外托管人或其委托机构进行代理投票。国外的公司治理标准、法律或监管要求和披露实务操作与中国的相关法律法规的规定存在差异。当需要对基金投资的注册地在中国以外的公司发行的和没有在中国证券交易所上市的有投票权的股票投票时，基金管理人将根据相关海外市场上适用的不同的法律法规，决定如何行使表决权。

4、在某些中国以外的法域中，就基金组合内公司的股份行使投票权的股东可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍组合管理且可能导致基金的流动性受损，如果存在此类限制，管理人在一般情况下将不行使代理投票权。此外，某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况，如果存在此类披露要求，管理人在一般情况下将不行使投票权，以保护基金持有信息。

5、基金管理人将保留投票权的记录，至少保存3年以上。其中包括：

- （1）基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料；
- （2）发行人的名称；
- （3）组合证券的代码；
- （4）会议日期；
- （5）会议上需投票的事项的简要描述；
- （6）需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出；
- （7）基金是否对该等事项进行了投票；
- （8）基金如何就该等事项进行了投票；

(9) 基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

## (二十) 证券交易管理

### 1、经纪商选择标准

我们选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，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；

(2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 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，选取适合基金投资业务的经纪商进行合作，并根据综合考察结果对经纪商交易量进行分配和调整。

### 3、佣金管理

基金管理人将严格遵守监管规定和与经纪商签订的协议，按照市场惯例确定佣金费率，我们将遵循以下基本原则：佣金是基金持有人的财产，基金管理人有责任尽可能降低交易成本。

交易佣金如有折扣或返还，应归入基金资产。

## (二十一) 投资的风险管理

本基金风险管理的原则为保护基金份额持有人利益。由于各地区、各资产类别的市场行情不断变化以及开放式基金现金流的个性化需求，本基金建立起一套动态的投资风险管理程序，做到事前管理、事中调整和事后评估。

事前管理是指基金管理人在投资决策委员会关于资产配置比例决策的基础上，根据市场预测数据，以及投资者现金需求的分析报告及申购赎回模型，结合现有基金组合的风险监控指标，评估未来一段时间内基金在大类资产配置、地域配置、个股个券选择等方面的操作空

间。事中调整是对基金投资风险进行事前管理的基础上，对投资组合的各项风险指标进行实时监控，根据风险指标所处的区域给予基金经理以不同的风险警示。事后评估是指定期对投资组合的各项风险监控指标进行评估，撰写评估报告，对投资组合的操作提出维持或修正建议，为投资组合下一步的调整及跟踪业绩比较基准偏离风险的控制提供量化决策依据。

本基金适时分析基金与业绩比较基准表现的偏离，计算跟踪误差，并对跟踪误差进行归因分析。

跟踪误差定义为：基金组合收益与业绩基准收益之差的标准差。公式为：

$$\text{跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (d_i - \bar{d})^2}{n-1}}$$

其中： $d_i$  = 第 i 日基金组合收益率 - 第 i 日比较基准收益率

$$\bar{d} = \frac{\sum_{i=1}^n d_i}{n}$$

n 为计算区间，本基金选定为 30 个交易日。

基金管理人将根据风险控制指标的变化，制定相应的策略，在进行主动管理的前提下，有效控制组合风险，持续优化投资组合信息比率，为投资者提供合理的风险调整后回报。

## （二十二）基金投资组合报告

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 10 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2012 年 9 月 30 日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----------	---------------

1	权益投资	82,469,662.51	89.59
	其中：普通股	82,469,662.51	89.59
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	9,178,083.66	9.97
8	其他各项资产	404,998.22	0.44
9	合计	92,052,744.39	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**

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	61,147,428.86	67.03
中国台湾	21,322,233.65	23.37
合计	82,469,662.51	90.40

3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	11,185,746.91	12.26
必需消费品	10,387,591.19	11.39
能源	6,875,069.25	7.54
金融	19,362,155.58	21.22
保健	8,483,590.34	9.30
工业	3,365,819.99	3.69
信息技术	17,751,006.39	19.46
材料	1,641,045.79	1.80
电信服务	2,695,534.72	2.95
公用事业	722,102.35	0.79
合计	82,469,662.51	90.40

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

序号	公司名称 (英文)	公司名 称 (中 文)	证券 代码	所 在 证 券 市 场	所 属 国 家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人民币 元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Media Tek Inc.	联发科 技股份 有限公 司	2454 TT	台 湾	中 国 台 湾	60,000	4,017,239.85	4.40
2	Sinopharm Group Co., Ltd.	国药控 股股份	1099 HK	香 港	中 国 香 港	190,000	3,861,337.13	4.23

		有限公 司						
3	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生 物制药 有限公 司	1177 HK	香 港	中国 香港	1,504,000	3,517,803.66	3.86
4	TPK Holding Co Ltd	宸鴻光 电科技 股份有 限公司	3673 TT	台 湾	中国 台湾	41,578	3,458,404.58	3.79
5	Capella Microsystems (Taiwan) Inc.	凌耀科 技股份 有限公 司	3582 TT	台 湾	中国 台湾	96,000	3,343,589.62	3.67
6	CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONA L LIMITED	中国光 大国际 有限公 司	257 HK	香 港	中国 香港	811,000	2,719,333.28	2.98
7	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	康师傅 控股有 限公司	322 HK	香 港	中国 香港	134,000	2,558,877.00	2.80
8	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤 酒股份 有限公 司	168 HK	香 港	中国 香港	68,000	2,380,183.33	2.61
9	Tencent Holdings Limited	腾讯控 股有限 公司	700 HK	香 港	中国 香港	10,900	2,355,141.68	2.58

10	Wei chuan food corp	味全食品工业股份有限公司	1201 TT	台湾	中国台湾	297,000	2,268,020.70	2.49
----	---------------------	--------------	---------	----	------	---------	--------------	------

**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**

本基金本报告期末未持有基金。

**10 投资组合报告附注**

10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

10.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**10.3 其他各项资产构成**

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	170,093.36



3	应收股利	215,734.98
4	应收利息	204.79
5	应收申购款	18,965.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	404,998.22

10.4 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。

10.5 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。

## 五、基金的业绩

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

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

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截至时间 2012 年 6 月 30 日）

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
2012年1月1日至2012年6月30日	1.88%	1.09%	3.42%	1.10%	-1.54%	-0.01%
自基金成立（2011年5月17日）至2011年12月31日	-20.20%	1.59%	-23.41%	1.71%	3.21%	-0.12%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 六、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：上海浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层
- 3、法定代表人：李勃
- 4、设立日期：1998年6月4日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
- 6、注册资本：1.5亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：(021) 38969999
- 11、客户服务电话：40088-50099
- 12、联系人：冯颖
- 13、网址：www.huaan.com.cn

### （二）注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气（集团）总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

### （三）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的姓名、从业简历、学历及兼职

情况等。

(1) 董事会：

朱仲群先生，研究生学历。历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长，国家开发银行办公厅处长，中国光大银行大连分行行长助理、监察室副主任，中国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理，长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事，现任上海国际集团有限公司总经理助理，华安基金管理有限公司董事长。

李勃先生，大学学历，高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理，北京汇正财经顾问有限公司董事总经理，上海证券交易所深圳办事处主任，中国投资信息有限公司董事总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总裁。

冯祖新先生，研究生学历。历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员，上海市经济委员会信息中心副主任、主任，上海市工业投资公司副总经理、总经理，上海工业投资（集团）有限公司副总裁，现任上海工业投资（集团）有限公司总裁、法定代表人、党委副书记。

马名驹先生，大学学历，高级会计师。历任上海凤凰自行车股份有限公司副董事长兼总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，现任上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理，锦江国际（集团）有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理、上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科科员、副处长、处长，上海市审计局财政审计处处长，现任上海电气（集团）总公司财务总监。

王松先生，研究生学历，高级经济师。历任建设银行总行投资部职员，国泰证券有限公司北京办事处副主任、发行二部副总经理、债券部总经理，国泰君安证券股份有限公司债券业务一部总经理、固定收益证券总部总经理、固定收益证券总部总监、总裁助理，现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。历任全国政协委员、政协经济委员会委员，北京大学经济学院教授、博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市，武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生，研究生学历，教授。历任上海财经大学科研处处长、上海财经大学南德管理学院院长、上海财经大学常务副校长，现任上海国家会计学院院长、党委书记，APEC 金融与发展项目执行秘书处秘书长，兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2) 监事会：

谢伟民先生，研究生学历，副教授。历任上海市城建沪南工务所干部，空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师，上海市计委直属机关党委干事，中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员（副处级）、副处长，中共上海市金融工作党委组织处（宣传处）副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记（正处级），现任华安基金管理有限公司监事会主席。

陈涵女士，研究生学历，经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长，现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生，研究生学历，高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长，上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长，上海电气（集团）总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

章卫进先生，大专学历，会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科员、外经处会计主管，英国 SONOFEC 公司（长驻伦敦）业务经理，上海有色金属总公司房产公司财务部经理、办公室主任，上海工业投资（集团）有限公司财务部业务主管、副经理、上海工业投资（集团）有限公司财务部经理。

李梅清女士，大专学历，会计师。历任上海新亚（集团）股份有限公司财务部副经理、上海新亚（集团）有限公司财务部副经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理、上海锦江国际投资管理有限公司财务总监。

汪宝山先生，大学学历，经济师。历任建行上海市分行团委书记、直属党委书记，建行宝山宝钢支行副行长，建行上海市分行办公室副主任，国泰证券公司综合管理部总经理，公

司专职党委副书记兼行政管理部总经理，公司专职党委副书记兼上海营业总部总经理，国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记，公司党委委员、工会主席，国泰君安投资管理股份有限公司董事长、党委书记、国泰君安证券股份有限公司党委委员。

赵敏先生，研究生学历，助理研究员。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总裁助理，兼任信息技术部总监。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监助理，现任华安基金管理有限公司集中交易部总经理。

(3) 高级管理人员：

朱仲群先生，研究生学历。历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长，国家开发银行办公厅处长，中国光大银行大连分行行长助理、监察室副主任，中国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理，长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事，现任上海国际集团有限公司总经理助理，华安基金管理有限公司董事长。

李勃先生，大学学历，高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理，北京汇正财经顾问有限公司董事总经理，上海证券交易所深圳办事处主任，中国投资信息有限公司董事总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总裁。

尚志民先生，工商管理硕士，15 年证券、基金从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任安顺证券投资基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。现任华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

秦军先生，研究生学历，13 年证券、基金从业经验，曾任中国航空工业规划设计研究院建设监理部总经理助理，中合资产管理有限责任公司北京分公司总经理，嘉实基金管理有限公司总经理助理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

章国富先生，研究生学历，25 年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经

理兼上海新鑫投资有限公司财务总监、华安基金管理有限公司督察长，现任华安基金管理有限公司副总裁。

薛珍女士，研究生学历，11 年证券、基金从业经验，曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局信息调研处处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长，现任华安基金管理有限公司督察长。

## 2、本基金基金经理

翁启森先生，工业工程学硕士，16 年证券、基金行业从业经验，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部副总经理。2010 年 9 月起担任华安香港精选投票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。

苏圻涵先生，博士研究生，8 年证券、基金从业经历，持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010 年 9 月起担任华安香港精选投票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。

## 3、本公司采取集体投资决策制度，国际投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

李 勍先生，总 裁

尚志民先生，副总裁、首席投资官

翁启森先生，全球投资部总经理、基金经理

陈宏初先生，全球投资部执行董事

上述人员之间不存在亲属关系。

## 4、业务人员的准备情况：

截至 2012 年 9 月 30 日，公司目前共有员工 305 人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中 81%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

## （四）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

- 2、办理基金备案手续；
- 3、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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **（五）基金管理人的承诺**

1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制处理本基金的投资；

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

3、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）除为基金管理人进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；



(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

#### 6、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、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

(3) 不泄露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) 除为基金管理人进行基金投资外，不直接或间接进行其他股票交易，也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### (六) 基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制的原则

##### (1) 健全性原则

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

##### (2) 有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

##### (3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

##### (4) 相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

##### (5) 成本效益原则

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

#### 2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

(1) 董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

(2) 监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

(3) 督察长：督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。

(4) 合规与风险管理委员会：合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

(5) 合规监察稽核部：合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，向公司合规与风险控制委员会和总经理报告。

(6) 风险管理部：风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监控和风险评估。

(7) 各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

### 4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### (1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部

控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来，通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识，致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设，建立了公司内部控制体系。

## （2）风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查，发现风险，将风险进行分类、按重要性排序，找出风险分布点，分析其发生的可能性及对目标的影响程度，评估目前的控制程度和风险高低，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后，确定应进一步采取的对应措施，对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善，并监督各个环节的改进实施。

## （3）控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中，也得到了一贯的实施。主要包括：组织结构控制、操作控制、会计控制。

### ①组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工，及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成权责分明、严格有效的三道监控防线：

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

### ②操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际

操作中遵照实施。

### ③会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；会计账务的组织 and 处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

### (4) 信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

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

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

### (5) 内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司的合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查，并提出改进意见和建议。

## 5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会 2011 年 3 月 7 日证监许可【2011】328 号文批准设立。

本基金自 2011 年 4 月 18 日起向全社会公开募集，截至 2011 年 5 月 13 日募集工作顺利结束。

本基金为契约型开放式，基金存续期间为不定期。

本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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者。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 434,522,995.91 元人民币，认购资金在募集期间产生的银行利息共计 55,146.58 元人民币。募集资金已于 2011 年 5 月 17 日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 2,250 户。按照每份基金份额初始发售面值 1.00 元人民币计算，设立募集期间募集的有效份额共计 434,522,995.91 份基金份额，利息结转的基金份额为 55,146.58 份基金份额。两项合计共 434,578,142.49 份基金份额，已全部计入本基金基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。其中，本公司基金从业人员认购持有的基金份额总额为 4,150,933.98（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.96%。按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担，不从基金资产中支付。

## 八、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2011 年 5 月 17 日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 九、基金份额的申购和赎回

### (一) 日常申购与赎回场所

#### 1、直销机构

(1) 华安基金管理有限公司上海业务部

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31层

电话：(021) 38969960

传真：(021) 58406138

联系人：姚佳岑

(2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话：(010) 57635999

传真：(010) 66214061

联系人：朱江

(3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区华夏路10号富力中心1203室

电话：(020) 38199200

传真：(020) 38927962

联系人：田峰

(4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街88号长安国际中心A座706室

电话：(029) 87651811

传真：(029) 87651820

联系人：史小光

(5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L

电话：(028) 85268583

传真：(028) 85268827

联系人：张彤

(6) 华安基金管理有限公司沈阳分公司

地址：沈阳市沈河区北站路59号财富中心E座2103室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：曹瀚

(7) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

华安电子交易手机网站：wap.huaan.com.cn

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

## 2、代销机构：

本基金代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“十九、相关服务机构”中“(一) 基金份额发售机构及其联系人”的相关描述。

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。基金投资者应当在销售机构基金销售业务的营业场所按销售机构约定的方式办理基金的申购、赎回与转换业务。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

## (二) 日常申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2日在指定媒体公告。

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及香港、台湾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、赎回日除外。投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间受理投资者的申购、赎回申请，但是对于投资者在非开放时间提出的申购、赎回申请，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。



如遇基金管理人依据《基金合同》作出暂停申购或赎回决定，基金管理人可决定是否将投资者于恢复开放申购或赎回前一日提出的申购或赎回申请顺延至下一开放日并以该开放日的申购、赎回价格确认投资者的申购、赎回申请。

若本基金的主要交易市场发生变化或交易所交易时间更改或实际情况需要，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，但此项调整应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

本基金已于 2011 年 6 月 17 日开始办理日常申购、赎回业务。

### （三）日常申购与赎回的原则

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

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日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，但必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （四）日常申购与赎回的程序

#### 1、日常申购和赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间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。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《基金合同》和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

#### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在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）后及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对投资者交易申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该交易申请。交易申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

### 3、申购和赎回的款项支付

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

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10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本基金合同有关规定处理。

## （五）申购和赎回的数额限制

1、投资者首次申购基金份额的最低金额为1,000元，追加申购最低金额为500元（含申购费）。各代销机构可根据自己的情况调整首次最低申购金额和最低追加申购金额限制。投资人已成功认购过本基金时则不受首次最低申购金额1,000元限制；投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于500份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不500份的，在赎回时需一次全部赎回。如因非交易过户、转托管、巨额赎回等原因导致的基金份额余额少于500份的情况，不受此限制，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整对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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## （六）申购费用与赎回费用

1、本基金申购费用在投资者申购基金份额时收取，不列入基金资产。投资者的申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
----------	------

$0 \leq M < 100$ 万	1.5%
$100 \text{万元} \leq M < 300 \text{万元}$	1.2%
$300 \text{万元} \leq M < 500 \text{万元}$	0.8%
$M \geq 500 \text{万元}$	每笔1000元

2、本基金赎回费用由投资者承担，在投资者赎回基金份额时收取。本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.5%，按持有期递减。本基金的赎回费用扣除注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的部分为赎回费的25%。具体费率如下：

持有期	赎回费率
一年以内（不含一年）	0.5%
一年至两年（不含两年）	0.25%
两年（含两年）以上	0

注：一年指365天，两年为730天，依此类推。

3、基金管理人对部分基金投资者费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并应在调整实施日前2个工作日前在至少一种指定媒体公告。

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。

### （七）申购份数与赎回金额的计算方式

#### 1、申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1）申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）赎回金额的处理方式：赎回总额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值，赎回金额为赎回总额扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 2、基金申购份额的计算

本基金采用“外扣法”计算申购费用及申购份额，具体计算公式如下：

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例四：某投资者投资 10 万元申购本基金，对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.015 = 97,066.18 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,066.18 份基金份额。

例五，某投资者一次性投资 5,000 万元申购本基金，对应单笔申购费为 1,000 元，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000,000 - 1,000 = 49,999,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,999,000 / 1.015 = 49,260,098.52 \text{ 份}$$

即投资者投资 5000 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 49,260,098.52 份基金份额。

### 3、基金赎回金额的计算

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

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

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

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

例六，某投资者持有本基金 10 万份基金份额 6 个月后赎回，赎回费率为 0.5%，假设赎

回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.015 = 101,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 101,500 \times 0.5\% = 507.50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 101,500 - 507.50 = 100,992.50 \text{ 元}$$

即投资者赎回本基金 10 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

#### 4、基金份额净值的计算

基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内披露。遇特殊情况，经中国证监会核准，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

### （八）申购和赎回的注册登记

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，并在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （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。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在三个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续两个或两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二十个工作日，并应当在指定媒体公告。

#### (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) 本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- (3) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或者由于主要投资市场在市场进入、投资额度、可投资对象等方面存在一定的限制，或者其它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；
- (4) 基金资产规模或者份额数量达到了国家外汇管理局核准的境外证券投资额度上限；
- (5) 因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- (6) 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申购；
- (7) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(8) 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。发生上述第(6)项以外的暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。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。

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) 发生连续巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- (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，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，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在 20 个工作日内予以支付。

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。

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，基金管理人应依照有关规定在指定媒体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 20 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，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定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。

### （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。

### （十二）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### （十三）基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1、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，基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。接受划转的主体必须是合格的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；

2、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，并向基金注册登记机构申请办理。

3、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。

4、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）时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

5、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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，被冻结部分产生的权益需一并冻结的，该等基金份额相关应分配红利将自动转为基金份额且一并冻结。

6、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、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

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、基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。

### （二）与基金销售有关的费用

#### 1、申购费用

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

#### 2、赎回费用

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

#### 3、销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

### （三）其他费用

1、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees）；

2、基金合同生效以后的信息披露费用；

3、基金份额持有人大会费用；

4、基金合同生效以后的会计师费和律师费以及其他为基金利益而产生的中介机构费用；

5、基金的资金汇划费用；

6、外汇兑换交易的相关费用；

7、与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等；

8、在中国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；

9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述基金费用中第1至8项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （五）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。

### （六）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

## 十一、基金的财产

### （一）基金财产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类证券或票据价值以及应计利息、银行存款本息和基金应收的款项以及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财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、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，在境外开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外资产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、基金托管人和境外资产托管人的固有财产。基金管理人、境外资产托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金托管人和境外资产托管人应安全保管基金财产。

3、基金管理人、基金托管人、境外资产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。

4、基金托管人或境外资产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、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产的估值

### （一）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，每个工作日对基金财产进行估值，T+1日完成T日估值。

### （三）估值对象

本基金所拥有的各类有价证券及本基金依据相关法律法规持有的其他资产。

### （四）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近

一日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）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）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估值方法估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值；

（4）对于首次发行未上市的债券按成本价估值；对于非上市债券，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。

3、因持有股票而享有的配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若配股权证可以在交易所交易，则按照 1 中确定的方法进行估值；不能在交易所交易的配股权证，如果股票收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，如果收盘价低于或等于配股价，则估值为零。

4、开放式基金的估值以其公布的估值日的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

5、基金持有的衍生工具等其他有价证券，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的有价证券按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，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；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

6、估值中的汇率选取原则：

1) 估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑、林吉特等六种主要货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的中间价。

2) 其他货币采用美元作为中间货币进行换算，与美元的汇率则以估值日彭博伦敦时间 16:00 报价数据为准。

7、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，基金将在相关税金支付日进行相应的估值调整。

8、在任何情况下，基金管理人如果采用本项 1-7 中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，如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布，但基金托管人就此保留向中国证监会报告的权利。

### **（五）估值程序**

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或以其他约定方式返回给基金管理人。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。

在法律法规允许的情况下，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交易市场或外汇交易中心遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

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

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

4、出现紧急事故情况，导致基金管理人不能出售或无法评估基金资产的情形；

5、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保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 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 0.5% 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 8 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、由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误, 或有关会计制度变化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。

3、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基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的, 相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。



## 十三、基金的收益与分配

### （一）利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、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；《基金合同》对冻结的基金份额参与分配另有规定的从其规定；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；
- 4、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低于面值；
- 5、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失归基金资产；
- 7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及相关手续费等内容。

### （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。

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。

### （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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于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分红实施日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值转成相应的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 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。

### （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、境外资产托管人相独立的、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，须通知基金托管人，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。

## 十五、基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过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。如本基金投资衍生品,应当在每个工作日计算并披露基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后,基金管理人将在每个估值日后的2个工作日内通过网站、基金份额发售网点以及其他指定媒体,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后2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；
- 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、更换投资顾问、境外资产托管人；
- 27、基金运作期间如遇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）基金份额持有人大会决议**

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

**（九）中国证监会规定的其他信息**

**（十）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。

## 十六、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事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及《基金合同》约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，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，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十五年以上。

## 十七、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。

## 十八、境外托管人

### 一、中银香港概况

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。

## 十九、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构及其联系人

(1) 华安基金管理有限公司上海业务部

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31层

电话：(021) 38969960

传真：(021) 58406138

联系人：姚佳岑

(2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话：(010) 57635999

传真：(010) 66214061

联系人：朱江

(3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区华夏路10号富力中心1203室

电话：(020) 38199200

传真：(020) 38927962

联系人：田峰

(4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街88号长安国际中心A座706室

电话：(029) 87651811

传真：(029) 87651820

联系人：史小光

(5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L

电话：(028) 85268583

传真：(028) 85268827

联系人：张彤



(6) 华安基金管理有限公司沈阳分公司

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：曹瀚

(7) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

华安电子交易手机网站：[wap.huaan.com.cn](http://wap.huaan.com.cn)

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

## 2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：(86) 10-66592638

传真：(86) 10-66594568

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：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

传真：010-66107571

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

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(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

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58766688

传真：021-58798398

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：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦半地下层 1、2、4-17、21-22 层

法定代表人：孙建一

联系电话：(0755) 25859591

传真号码：(0755) 25878304

客户服务电话：95511—3

网址：bank.pingan.com

(8) 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

客户服务电话：95568

传真：(010) 68466796

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

(9) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：(010) 85238570/ 85239938

传真：(010) 85239605

客户服务电话：95577

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

(10) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476215

客户服务电话：(021) 962888

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

(11) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：(0577) 88999906

客户服务电话：(0577) 96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

(12) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市新华北路8号

法定代表人：农惠臣

电话：（0991）8824667

传真：（0991）8824667

客户服务电话：96518

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

(13) 广州银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市越秀区广州大道北195号

办公地址：广东省广州市越秀区广州大道北195号

法定代表人：姚建军

电话：020-37598339

传真：（020）37590798

客户服务电话：96699（广州）、400-83-96699（全国）

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

(14) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路288号

办公地址：杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

电话：（0571）87659009，87659816

传真：（0571）87659826

客户服务电话：95527

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

(15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

电话：（021）38676666

传真：（021）38670161

客户服务电话：400-8888-666

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

(16)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 23219000

传真：(021) 63410456

客户服务电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

(17)申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

客户服务电话：(021) 962505

网址：www.sywg.com

(18)长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：胡运钊

电话：400-8888-999

网址：www.cjsc.com.cn

(19)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

电话：(022) 28451861

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.ewww.com.cn

(20)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.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 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

客户服务电话：95503

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

(22) 方正证券股份有限公司

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

办公地址：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

电话：(0731) 85832343

传真：(0731) 85832342

客户服务电话：95571

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

(23) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

电话：(021) 53519888

传真：(021) 53519888

客户服务电话：4008918918

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

(24) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

电话：(0731) 4403343

传真：(0731) 4403439

客户服务电话：0731-84403304

网址：www.cfzq.com

(25)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

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

电话：(0471) 4913998

传真：(0471) 4930707

客户服务电话：(0471) 4961259

网址：www.cnht.com.cn

(26)国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

电话：(0791) 6289771

传真：(0791) 6289395

网址：www.gsstock.com

(27)齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

传真：(0531) 68889752

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(28)中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：杜航

电话：(0791) 6768763

传真：(0791) 6789414

客户服务电话：4008866567

网址：www.avicsec.com

(29) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人：姚文平

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客户服务电话：4008888128

网址：www.Tebon.com.cn

(30) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：(029) 87406172

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com.cn

(31) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：(0755) 82023442

传真：(0755) 82026539

网址 www.cjis.cn

客服电话：400-600-8008

(32) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：刘东

电话：(020) 88836999

传真：(020) 88836654



客户服务电话：961303、(020) 83963933

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

(33)中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

电话：(0755) 82943755

传真：(0755) 82940511

客户服务电话：4001022011

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

(34)江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：(0451) 82336863

传真：(0451) 82287211

客户服务电话：40066-62288

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

(35)华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122107

传真：(021) 50122078

客户服务电话：4008209898

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

(36)中信证券（浙江）有限责任公司

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

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

法定代表人：沈强

联系电话：(0571) 87112510

传真号码：（0571）85783771

客户服务电话：（0571）96598

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

(37) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

电话：（021）38784818

传真：（021）68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877、（021）38784818

公司网站：[www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

(38) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客服电话：（0571）96336（浙江）、40086-96336（全国）

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

## （二）注册登记机构

华安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

法定代表人：李劼

电话：（021）38969999

传真：（021）33627962

联系人：赵良

客户服务中心电话：40088-50099

## （三）律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358716

联系人：王利民

经办律师：秦悦民、王利民

#### **(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

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

经办会计师：汪棣、沈兆杰

## 二十、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 二十二、对基金投资人的服务

本公司承诺为基金投资人提供一系列的服务，并将根据基金投资人的需要和市场的变化，适时对服务项目进行调整。主要服务内容如下：

### （一）投资人投资记录邮寄服务

投资人投资记录邮寄服务包括季度对账单和年度对账单。在从销售机构获取准确的邮政地址、邮政编码的前提下，注册登记机构以书面形式在每季度结束后15个工作日内向本季度有交易的投资人寄出季度对账单；在每年度结束后20个工作日内向持有本基金的所有投资者寄出年度对账单。在获得基金持有人预留的电子邮箱的前提下，注册登记机构可以电子文件形式提供上述对账单递送。

### （二）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供7X24小时的基金净值信息、投资人账户交易情况、基金产品与服务等信息的自助查询。

客户服务中心人工座席提供每周7天的座席服务（法定节假日除外），基金投资人可以通过客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、账户资料修改等专项服务。

### （三）网络在线服务

投资人可以通过本公司网站的“在线客服”在线就基金投资、交易操作中的各种问题进行咨询互动或留言。

### （四）信息定制服务

投资人可以通过拨打本公司客服热线、发送邮件或者直接登录本公司网站定制基金净值、交易确认信息、电子对账单、定期资讯等信息服务。

### （五）投诉受理服务

投资人可以通过各销售机构网点柜台、客服热线人工服务、在线客服、客服电子邮箱、纸质信函等多种不同的渠道提出投诉或意见。本公司对于工作日期间受理的投诉，原则上在受理投诉后1个工作日内回复；对于不能及时回复的投诉，本公司承诺在3个工作日内给予答复。对于非工作日提出的投诉，将在顺延的工作日当日进行回复。

### （六）电子直销交易服务

依据相关的招募说明书、基金合同的约定以及《开放式基金业务规则》的规定，本公司可向个人投资人和机构投资者提供基金电子直销交易服务。本公司基金电子交易服务内容及

相关结算方式安排如下：

1、基础交易服务

受理包括基金认购、赎回转认购、基金申购、基金转换、基金赎回、直销转托管、代销份额托管转入的交易申请与撤销。

2、定期交易服务

受理包括定期定额、定期不定额、组合定投交易计划的创建、修改、撤销、暂停与恢复申请，并根据交易计划的内容为投资人定时自动提交交易申请。

3、预约交易服务

受理包括预约认购、预约赎回转认购、预约申购、预约转换、预约赎回交易计划的创建、修改、撤销申请，并根据交易计划的内容为投资人自动提交交易申请。其中预约认购、预约赎回转认购交易计划可按指定日期进行预约；预约申购、预约转换、预约赎回交易计划可按收盘点位、指定日期、基金涨跌、指数波动、相对点位、均线事件进行预约。

4、创新型交易服务

受理包括趋势定投、智赢定投、利增利、自动停损、智能再平衡交易计划的创建、修改、暂停与恢复、撤销申请，并根据交易计划的内容、投资人账户资产及投资收益等信息，定期或不定期地为投资人自动提交交易申请。

5、基金电子直销交易结算方式

本公司已开通的基金电子直销交易资金结算的银行包括：工商银行、建设银行、农业银行、中国银行、交通银行、招商银行、浦发银行、民生银行、兴业银行、中信银行、光大银行、平安银行、浙商银行、上海银行、南京银行、杭州银行、上海农商、温州银行、邮储银行。

本公司已开通的基金电子直销交易资金结算的第三方支付渠道包括：银联通、天天盈、通联支付。

基金电子直销交易资金结算模式包括“自动扣款模式”和“页面支付模式”。

不同结算银行、第三方支付渠道所支持的结算模式以及交易费用优惠信息如下表所示：

结算银行	银行直连	第三方支付(申购 4 折/定投 4 折/转换 4 折)		
		银联通	天天盈	通联支付
工商银行	自动扣款(申购 8 折/定投 8 折/转换 4 折)	-	自动扣款	自动扣款
建设银行	自动扣款(申购 8 折/定投 5 折/转换 4 折)	-	自动扣款	-

结算银行	银行直连	第三方支付(申购4折/定投4折/转换4折)		
		银联通	天天盈	通联支付
农业银行	自动扣款(申购7折/定投4折/转换4折)	-	自动扣款	自动扣款
中国银行	-	-	自动扣款	-
交通银行	页面支付(申购8折/转换4折)	-	-	-
招商银行	自动扣款(申购8折/定投8折/转换8折)	-	-	-
浦发银行	自动扣款(申购4折/定投4折/转换4折)	-	自动扣款	自动扣款
民生银行	自动扣款(申购4折/定投4折/转换4折)	-	自动扣款	-
兴业银行	-	页面支付	-	-
中信银行	-	页面支付	-	-
光大银行	-	-	自动扣款	自动扣款
平安银行	-	-	-	自动扣款
浙商银行	-	页面支付	-	-
上海银行	-	-	自动扣款	自动扣款
南京银行	-	页面支付	-	-
杭州银行	-	页面支付	-	-
上海农商	-	页面支付	-	-
温州银行	-	页面支付	-	自动扣款
邮储银行	-	-	-	自动扣款

## 6、电子直销交易服务平台

基金管理人提供的基金电子直销交易服务平台包括：网上平台（以下简称“WEB”）、手机WAP平台（以下简称“WAP”）、智能手机APP平台（以下简称“APP”）、电话语音平台（以下简称“IVR”）。对于不同类型的资金结算模式，不同平台所支持的交易功能有所差异，详见下表：



交易功能		自动扣款模式				页面支付模式			
		WEB	WAP	APP	IVR	WEB	WAP	APP	IVR
基础交易	认购	支持	支持	支持	支持	支持	-	-	-
	赎回转认购	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持
	申购	支持	支持	支持	支持	支持	-	-	-
	转换	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持
	赎回	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持
	直销转托管	支持	-	-	-	支持	-	-	-
	代销份额托管转入	支持	-	-	-	支持	-	-	-
定期交易	定期定额	支持	支持	支持	-	转/赎	支持	转/赎	-
	定期不定额	支持	-	支持	-	转/赎	-	转/赎	-
	组合定投	支持	-	支持	-	转	-	转	-
预约交易	预约认购	支持	支持	支持	-	-	-	-	-
	预约赎回转认购	支持	支持	支持	-	支持	支持	支持	-
	预约交易	支持	支持	支持	-	转/赎	转/赎	转/赎	-
创新交易	趋势定投	支持	-	支持	-	转	-	转	-
	智赢定投	支持	-	-	-	转	-	-	-
	利增利	支持	-	支持	-	转	-	转	-
	自动停损	支持	-	支持	-	转	-	转	-
	智能再平衡	支持	-	-	-	支持	-	-	-

注：

1. 上表中的“支持”表示该平台下的对应支付模式支持该功能的所有类型交易；
2. “转”表示该平台下的对应支付模式仅支持该功能的转换交易；
3. “赎”表示该平台下的对应支付模式仅支持该功能的赎回交易。

### （七）电子查询服务

本公司向个人投资人和机构投资者提供电子查询服务。具体查询服务内容以及相关的服务平台如下：

- 1、账户资产/收益查询服务，支持按照“基金产品”和“交易账户”两种不同的汇总方

式进行查询；

2、定期交易计划资产/收益独立核算服务；

3、跨账户查询服务，投资人可将多个基金账户进行关联并查询；

4、历史委托、历史成交、电子对账单查询服务，允许投资人查询任意时间区间的历史委托、历史成交和电子对账单；

5、账户管理服务，本公司提供账户信息修改、风险测评、密码修改、分红方式修改、银行卡管理（用于开通或关闭电子直销交易功能、增加或减少资金结算银行账户）服务；

6、账单定制与服务定制，本公司提供对账单定制服务，以及其他电子服务的定制：交易确认短信、交易确认E-mail、电子交易委托短信、电子交易账户变更短信、周净值短信；

7、电子查询服务平台，本公司提供的电子查询服务平台包括：网上平台、手机WAP平台、智能手机APP平台、电话语音平台。对于不同渠道的投资人，不同平台所支持的功能有所差异，详见下表：

查询功能	电子直销投资人				代销投资人			
	WEB	WAP	APP	IVR	WEB	WAP	APP	IVR
资产状况查询	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持
投资收益查询	支持	-	支持	-	支持	-	支持	-
资产/收益变动曲线	支持	-	支持	-	支持	-	支持	-
跨账户查询	支持	-	-	-	支持	-	-	-
定期交易计划 资产/收益独立核算	支持	-	支持	-	-	-	-	-
当日委托查询	支持	支持	支持	支持	-	-	-	-
历史委托查询	支持	支持	支持	-	支持	支持	支持	-
历史成交查询	支持	-	支持	支持	支持	-	支持	支持
电子对账单查询	支持	-	-	-	支持	-	-	-
账单定制	支持	支持	支持	-	支持	支持	支持	-
服务定制	支持	-	-	-	支持	-	-	-
分红方式修改	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持
银行卡管理	支持	-	-	-	支持	-	-	-
密码修改	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持	支持

查询功能	电子直销投资人				代销投资人			
	WEB	WAP	APP	IVR	WEB	WAP	APP	IVR
风险测评	支持	-	-	-	支持	-	-	-
账户资料修改	支持	支持	支持	-	支持	支持	支持	-

(八) 基金管理人客户服务联系方式

客户服务中心热线：40088-50099（免长途话费）

人工座席服务时间：交易日9:00-21:00

在线客服人工服务时间：交易日9:00-21:00

客户服务传真：(021) 33626962

公司网址：www.huaan.com.cn

手机网址：wap.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

客服地址：上海市四平路1398号 同济联合广场B座 14楼

邮政编码：200092

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人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。

## 二十四、其他应披露事项

1. 最近三年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到过中国证监会及工商、财税等有关机关的处罚。

### 2. 本期公告事项

序号	公告事项	信息披露报纸名称	披露日期
1	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年6月27日
2	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年6月29日
3	华安大中华升级股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2012年第1号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年6月29日
4	华安基金管理有限公司关于电子直销平台开通“智能再平衡”基金电子交易业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年7月3日
5	华安大中华升级股票型证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年7月18日
6	华安基金管理有限公司关于电子直销平台开通“农行机构电子直销”业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年7月20日
7	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠	上海证券报、中国证券报、证券时报	2012年8月4日

	活动的公告		
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙商银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年8月6日
9	华安大中华升级股票型证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年8月27日
10	基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年9月24日
11	基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年9月24日
12	基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年9月24日
13	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年9月28日
14	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年10月18日
15	华安大中华升级股票型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年10月26日
16	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2012年11月3日

## 二十五、备查文件

### (一) 备查文件

- 1、中国证监会批准证券投资基金设立的文件
- 2、基金合同
- 3、法律意见书
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、托管协议
- 7、中国证监会要求的其他文件

(二) 存放地点：基金管理人和基金托管人的住所。

(三) 查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇一二年十二月二十八日

## 附件一：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

##### 1、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，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续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；

(18) 选择、更换基金投资顾问；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 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。

## 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) 编制季报、半年报和年度基金报告；

(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、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) 基金管理人对其委托的投资顾问及其他第三方机构的行为承担责任。

(23) 中国证监会规定的其它职责。

## (二) 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) 选择、更换境外资产托管人并为之签署有关协议；

(7) 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，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) 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；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、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、季度、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；

(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；

(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) 对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任。基金托管人委托的第三方机构不包括相关司法管辖区域内的证券登记、清算机构、第三方数据和信息来源机构、根据当地市场惯例无法向该服务提供方追偿的其他机构。

(21) 中国证监会规定的其他职责。

### **(三) 基金份额持有人的权利和义务**

#### **1、基金份额持有人的权利**

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7) 监督基金管理人的投资运作;

(8) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

## 2、基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、基金合同;

(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获得的不当得利;

(7) 遵守基金管理人及其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召集、议事及表决的程序和规则

(一) 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组成。

(二) 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。

(三) 以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式。在法律法规和本基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
- 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它情形。

(四) 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。

#### （五）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；
- 3、投票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，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。

#### （六）开会方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等法律法规或监管机构允许的其他方式召开。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；
- 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不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；
- 4、直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的其它代表，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；

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不变。

在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权。

在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### (七) 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%或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。

#### （八）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百分之五十以上（含百分之五十）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提前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。

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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的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，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### （九）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，则监督员由基金管理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。

## (十) 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。

(十一) 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、基金合同解除和终止的事由、程序

### （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事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及《基金合同》约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，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，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十五年以上。

### 四、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）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。

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

## 五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

(一)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。

(二)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。

## 附件二：基金托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

法定代表人：李勃

成立日期：1998年6月4日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号

经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事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：壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

#### （二）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

联系人：王娟

联系电话：(010) 66594909

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付

款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》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《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。监督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。

(二)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业务复核。

(三)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。

（四）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。

（五）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。

（六）基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性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。

（七）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。

### 三、基金管理人<sup>对</sup>基金托管人的业务核查

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

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

（三）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、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，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。

(二) 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。

(三) 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。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。

(四) 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代理人均不得出借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。

(五) 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。

(六) 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。基金托管人对基金托管人及其境外托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

(七) 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。

## 五、基金资产净值计算与复核

基金资产净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

#### （一）基金财产定价

基金托管人、境外托管人负责按基金管理人和基金托管人约定的定价原则对基金财产进行定价。在进行资产定价时，基金托管人、境外托管人有权本着诚意原则，依赖本协议所约定的经纪人、定价服务机构或其他机构的定价信息，但在不存在过错的前提下，基金托管人、境外托管人对上述机构提供的信息的准确性和完整性不作任何担保，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的基金管理人或基金财产损失不负任何责任。

#### （二）基金资产净值的计算和复核

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。

##### 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，基金管理人将前一日基金估值结果以双方确认的形式报送基金托管人。基金托管人对净值计算结果进行复核，并在当日 18:00 之前以双方确认的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；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。

### （三）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编制，基金托管人复核。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40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60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 15 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 25 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月度报告上加盖业务章，在季报、半年报和年报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。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）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。

### （二）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。

### （三）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。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商解决，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。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）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。

### （二）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。

(三) 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。