

**建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）  
招募说明书（更新）  
2016年第1号**

**基金管理人：建信基金管理有限责任公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**二〇一六年五月**

## 【重要提示】

建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）由建信优势动力股票型证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2013年3月1日证监许可[2013]204号文核准的《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金有关转型基金运作方式决议的批复》，建信优势动力股票型证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金（LOF）、调整基金投资比例、修订基金合同，并更名为“建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）”。自2013年3月19日起，由《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

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

基金管理人保证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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。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，由于本基金可能因为暂时未达到上市条件而不能上市交易所产生的流动性风险，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。本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。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。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 3 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

一、绪言	5
二、释义	6
三、基金管理人	11
四、基金托管人	20
五、相关服务机构	24
六、基金的历史沿革	29
七、基金的存续	30
八、基金份额的上市交易	31
九、基金份额的申购与赎回	32
十、基金的投资	41
十一、基金的业绩	52
十二、基金的财产	53
十三、基金资产的估值	54
十四、基金的收益分配	59
十五、基金的费用与税收	61
十六、基金的会计与审计	63
十七、基金的信息披露	64
十八、风险揭示	68
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	71

二十、基金合同的内容摘要.....	73
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	90
二十二、对基金份额持有人的服务.....	102
二十三、其他应披露事项.....	105
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	106
二十五、备查文件.....	107

## 一、绪言

《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规的规定以及《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者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、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人员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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）
- 2、原建信优势动力基金：指建信优势动力混合型证券投资基金，该基金为封闭式基金
- 3、基金管理人或本基金管理人：指建信基金管理有限责任公司
- 4、基金托管人或本基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 5、基金合同：指《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其任何有效修订和补充，基金合同由《建信优势动力混合型证券投资基金基金合同》修订而成
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充，托管协议由《建信优势动力混合型证券投资基金托管协议》修订而成
- 7、招募说明书：指《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期的更新
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
- 9、《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，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时作出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
- 11、《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》及对其不时作出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订
- 13、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政

区、澳门特别行政区和台湾地区

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者

20、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

21、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

22、基金销售业务：指基金管理人或代销机构办理基金的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指直销机构和代销机构

24、直销机构：指建信基金管理有限责任公司

25、代销机构：指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位

26、基金销售网点：指直销机构的直销网点及代销机构的代销网点

27、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者开放式基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等



28、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

29、基金合同生效日：指《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日。基金合同自原建信优势动力基金存续期届满日次日（即2013年3月19日）起生效，原《建信优势动力混合型证券投资基金基金合同》自该日起终止

30、基金合同终止日：指基金合同规定的终止事由出现后按照基金合同规定的程序并经中国证监会核准或备案后终止基金合同的日期

31、基金转型：指原建信优势动力基金的存续期届满后，变更基金的运作方式，基金更名为“建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)”，并相应修订基金合同等一系列事项的统称

32、存续期：指原《建信优势动力混合型证券投资基金基金合同》生效至《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、日：指公历日

35、月：指公历月

36、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

37、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

38、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

39、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、申购：指基金合同生效后，基金投资者申请购买基金份额的行为

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

42、上市交易：指基金存续期内，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

43、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

44、销售场所：指场外销售场所和场内交易场所，分别简称为场外和场内

45、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额申购和赎回的场所

46、场内：通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所

47、注册登记系统：指中国证券登记结算有限公司开放式基金登记结算系统

48、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限公司深圳分公司证券登记结算系统

49、系统内转托管：指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单位）之间进行转托管的行为

50、跨系统转登记：指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

51、深圳证券账户：指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

52、开放式基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

53、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户

54、元：指人民币元

55、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、已实现的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

56、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

57、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

58、**基金份额净值**：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

59、**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

60、**指定媒体**：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

61、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

设立日期：2005年9月19日

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由6名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

许会斌先生，董事长。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。自2011年3月至2015年3月，出任中国建设银行批发业务总监；自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长；自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理。许先生是高级经济师，并是国务院特殊津贴获得者，曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。

孙志晨先生，董事。现任建信基金管理有限责任公司总裁，兼建信资产管理公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席

营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院，1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理，博时基金管理有限公司常务副总经理，新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险（加拿大）有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获 Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

## 2、监事会成员

王雪玲女士，监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业工商管理专业，高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员；中国建设银行新疆区分行计划处、信贷处、风险处和人力部等副处长、处长、行长助理、副行长；中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团财务有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

吴灵玲女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总经理兼综合管理部总经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系；2001年毕业于北京师范大学经济系。曾任中国建设银行总行人力资源部主任科员、高级经理助理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理部总监助理、副总监、总监。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业，获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技部科员、中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总监助理、副总监；信息技术部副总监、总监。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

### 3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张威威先生，副总裁。1997年毕业于大连理工大学，获学士学位；2003年毕业于大连理工大学，获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行筹资处科员、主任科员；中国建设银行总行个人银行业务部主任科员、高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副

总裁。

曲寅军先生，副总裁。1996年毕业于中国人民大学，获学士学位；1999年毕业于中国人民大学，获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员、副主任科员；团委主任科员；重组改制办公室高级副经理；行长办公室高级副经理。2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月至今，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理，并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副总裁。

#### 4、督察长

吴曙明先生，督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系，获学士学位；1999年毕业于财政部财政科学研究所，获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行总行，先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，曾任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职。2006年3月加入建信基金管理公司，担任董事会秘书兼综合管理部总监。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

#### 5、本基金基金经理

姜锋先生，硕士。2007年7月毕业于中国人民银行研究生部获金融学硕士学位，同年加入本公司，从事行业研究，任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金基金经理；2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理；2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。

历任基金经理：

万志勇：2011年7月11日至2015年9月28日

姜锋：2011年7月11日至今

#### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。



钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁，固定收益投资部总经理

姚锦女士，权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。

顾中汉先生，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部基金经理。

**7、上述人员之间均不存在近亲属关系。**

### **（三）基金管理人的职责**

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、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值；

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、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （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及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （4）不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

## （五）基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

- （1）全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。
- （2）独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。
- （3）相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，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。
- （4）有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对其工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。
- （5）防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。
- （6）适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，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和完善。

### 2、内部控制的主要内容

### （1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立了审计与风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### （2）风险评估

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

### （3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

### （4）信息与沟通

公司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，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：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

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：汤嵩彦

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2015年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第17位，较上年上升2位；根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第190位，较上年上升27位。

截至报告期末，交通银行资产总额为人民币71,553.62亿元。报告期内，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币665.28亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

## （三）基金托管业务经营情况

截至2015年12月31日，交通银行共托管证券投资基金146只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

### 二、基金托管人的内部控制制度

#### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

## （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

## （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员

守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。



## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

##### （1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

##### （2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

#### 2、场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站([www.szse.cn](http://www.szse.cn))。

#### 3、场外代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### （2）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.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

客服电话：95588

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

（4）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

客服电话：95558

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

（5）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（6）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（7）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客户服务电话：400-820-2819

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

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

（8）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com/](http://www.noah-fund.com/)

（9）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

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

（10）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

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

（11）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

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

（12）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

（13）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

客户服务热线：4000-466-788

（14）中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

客服电话：400 9908 826

网址：<http://www.citicsf.com>

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：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

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

## （四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

## 六、基金的历史沿革

建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）由建信优势动力股票型证券投资基金转型而成。

建信优势动力混合型证券投资基金遵照《基金法》于 2008 年 2 月 1 日获中国证监会证监许可[2008]216 号文批准募集。

建信优势动力混合型证券投资基金基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。基金管理人于 2008 年 3 月 19 日获得中国证监会书面确认，《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模 46.43 亿份。建信优势动力股票型证券投资基金基金合同生效后，存续期为五年。

2013 年 1 月 28 日建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论建信优势动力股票型证券投资基金转型议案，内容包括建信优势动力股票型证券投资基金在存续期届满前变更运作方式(即变更为上市开放式基金(LOF))、调整基金投资比例，基金更名和修订基金合同等。依据中国证监会 2013 年 3 月 1 日证监许可[2013]204 号文核准，持有人大会决议生效。

根据建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议，自 2013 年 3 月 19 日起《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》失效且《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。基金转型为上市开放式基金后，存续期为不定期，同时基金更名为“建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)”。

根据 2014 年 8 月 8 日证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)自 2015 年 7 月开始更名为建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)。

## 七、基金的存续

### （一）基金份额的变更登记

基金份额的变更登记是指建信优势动力股票型证券投资基金终止上市后，基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司取得终止上市权益登记日基金份额持有人名册，并进行基金份额更名以及必要的信息变更之后，中国证券登记结算有限责任公司根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会报告，并说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的上市交易

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （二）上市交易的时间

本基金在基金合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在指定媒体上刊登公告。

基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内后，方可上市交易。

### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循深圳证券交易所相关业务规则及规定。

### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

（七）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，并按照新



规定执行，此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。

具体销售机构和会员单位见招募说明书第五章“相关服务机构”第（一）节“基金份额销售机构”。

基金管理人可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）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

在基金开放日，投资人提出的申购、赎回申请时间应在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间（即下午3:00）之前，其基金份额申购、赎回的价格为当日的价格；如果投资人提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间之后，其基金份额申购、赎回的价格为下一开放日的价格。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起三个月内开始办理申购、赎回。

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、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回、转换的价格。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

### (三)申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、场外的基金份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金投资者申购的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；

6、投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券账户。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (四)申购与赎回的程序

#### 1.申购和赎回的申请方式

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

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

#### 2.申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内（包括该

日）对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)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，投资人的申购和赎回申请是否成功，以注册登记机构的确认结果为准。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### (五) 申购和赎回的金额和数量限制

1、代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为 10 元人民币，代销机构另有规定的，从其规定；本公司直销柜台每个基金账户首次、单笔申购最低金额均为 10 元人民币；通过本公司网上交易申购本基金时，申购、定投最低金额均为 10 元人民币。

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 10 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

### (六) 申购费与赎回费

#### 1、申购费

本基金对申购设置级差费率，场内申购和场外申购执行统一收费标准。申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过1.50%。

投资人可以多次申购基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。销售机构另有规定的，从其规定。

申购金额(M)	申购费率
M<100 万元	1.50%
100 万元≤M<500 万元	1.0%
M≥500 万元	1000 元/笔

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，具体赎回费率如下表所示：

持有期限 (Y)	场外赎回费率	场内赎回费率
Y<1年	0.50%	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%	0.50%
Y≥2年	0%	0.50%

注：Y为基金份额持有期限；1年指365天。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以按照基金合同的相关规定调整申购费率或收费方式，或者调低赎回费率，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体公告。

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

## （七）申购份数与赎回金额的计算方式

## 1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

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

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

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

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人投资5万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.50\%) = 49261.08 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{份}$$

即：投资人投资5万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则其可得到46915.31份本基金基金份额。

## 2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

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

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

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

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人通过场外赎回本基金 50000 份基金份额，赎回适用费率为 0.25%，假设赎回当日本基金基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 50000 \times 1.148 = 57400 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 57400 \times 0.25\% = 143.5 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 57400 - 143.5 = 57256.5 \text{元}$$

即：投资人赎回本基金 50000 份基金份额，假设赎回当日本基金基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 57256.5 元。

### 3、基金份额净值计算

基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### (八)拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；
- 2、证券交易所交易时间临时停市，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、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障等异常情况发生导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- 7.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### (九)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；

2、证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。暂停赎回或延缓支付款项的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。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予以公告。

#### (十)巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定对场外赎回申请接受全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未

能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3)暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经确认成功的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### 4、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### (十一)暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### (十二)基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十三)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行



行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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；捐赠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、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，受理非交易过户申请的销售机构可按规定标准收取过户费用。

#### (十四)基金的系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

2、本基金系统内转托管按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额不能办理系统内转托管。

#### (十五) 基金的跨系统转托管

1、跨系统转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额不能办理跨系统转托管。

#### (十六)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人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。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### (十七)基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，对冻结部分产生的权益一并冻结。



## 十、基金的投资

### （一）投资目标

采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。

### （二）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，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

### （三）投资理念

通过深入研究宏观经济环境、市场环境、行业特征和上市公司基本面，精选具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司，以此为基础进行积极投资管理，为投资者创造超额收益。

### （四）投资业绩比较基准

本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

如果指数编制单位停止编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金管理人有权对此基准进行调整并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## （五）投资策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策，具体包括以下几个方面：

### 1、资产配置策略

本基金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。在此基础上，本基金管理人将综合运用定性分析和定量分析手段，对大类资产进行合理配置。

本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点，对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

本基金进行资产配置时所参考的主要指标包括国内生产总值（GDP）增长率、货币供应量及其变化、利率水平及其预期变化、通货膨胀率、货币与财政政策、汇率政策等。

除基本面因素以外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益与风险水平的因素，观察市场信心指标、行业动量指标等，力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。

通常情况下，基金管理人会定期根据市场变化，以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下，亦可针对市场突发事件等在本基金投资范围及各类资产配置比例限制范围内进行及时调整。

### 2、股票投资策略

股票投资策略可以分为行业配置和个股选择两个层面。

#### （1）行业配置

基金管理人会对宏观经济形势与政策、行业景气程度、拟投资上市公司代表性等方面进行研究，以此为基础，以投资业绩比较基准中各个行业的权重为参照，进行行业配置决策。

各行业之间的预期收益、风险及其相关性仍然是制定行业配置决策时的根本因素，因而基金管理人的研究将围绕着对它们产生重大影响的因素或指标展开，主要包括各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、拟投资上市公司代表性、行业整体估值水平等等。

通过对上述因素或指标的综合评估，基金管理人定期确定各行业的配置水平，并据此对股票投资组合的行业配置进行调整。如果发生重大事件，基金管理人亦可在本基金投资范围内对行业配置进行及时调整。

## （2）股票选择

本基金管理人通过对宏观经济、行业、子行业、上市公司的详细分析来选择具备良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司。

内生性成长动力方面重点关注上市公司的产品或服务的供需情况、竞争结构以及公司的管理和治理水平等因素，所依据的指标主要是上市公司的净资产收益率（ROE）。

外延式扩张动力方面主要考虑上市公司整体上市、大股东资产注入的可能性以及公司的并购价值和整合前景等，将重点关注上市公司和关联方的优质资产状况和扩张战略等因素，所依据的指标主要是上市公司每股收益（EPS）的预期增长幅度。

在具备良好内生性成长或外延式扩张动力的备选股票构成的股票池基础上，本基金管理人将通过绝对估值与相对估值，结合上市公司的成长性对其股票的内在价值进行判断并与当前股价进行比较，对股票的投资价值做出判断。所依据的指标包括上市公司未来预期利润水平、预期市盈率水平等。

本基金奉行“成长与价值相结合”的选股原则，即选择具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司进行投资。同时，投资业绩比较基准中的股票将是本基金重点关注的对象。

## 3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

### （1）债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济和货币政策的基础上，采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。

#### （2）个券选择策略

在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

- ①有较高信用等级的债券；
- ②在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，到期收益率较高的债券；
- ③有良好流动性的债券；
- ④风险水平合理、有较好下行保护的债券。

#### 4、权证投资策略

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，综合运用杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等策略获取权证投资收益。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将仔细研究资产支持证券池中资产的情况以及发行主体的资信，认真分析相关证券的结构，综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估资产支持证券的风险收益。重点关注具有以下一项或多项特征的产品：

- （1）有较高信用等级；
- （2）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，收益率较高；
- （3）风险水平合理、有较好下行保护。

### （六）投资管理体制及流程

#### 1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、跟踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

## **2、投资流程**

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制，具体的投资管理流程包括研究分析、投资决策、交易执行和投资回顾。

### **（1）研究分析**

研究部及投资管理部广泛地参考和利用公司内、外部的研究成果，走访拟投资公司或其他机构，进行深入细致的调查研究，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，挖掘有投资价值的拟投资上市公司，同时，建立相关研究模型。研究部撰写宏观策略报告、行业策略报告和拟投资上市公司投资价值分析等报告，作为投资决策依据之一。

研究部和投资管理部定期或不定期举行投资研究联席会议，讨论宏观经济、行业、拟投资上市公司及相关问题，作为投资决策的重要依据之一。

### **（2）投资决策**

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围，审批总体投资方案以及重大投资事项。

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

委员会审议。

### （3）交易执行

交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后，首先应对指令予以审核，然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并及时通知基金经理或相关人员。

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

### （4）投资回顾

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

## （七）基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

## （八）投资限制

### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、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。



## 2、基金投资组合比例限制

- （1）本基金股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；
- （2）持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；
- （3）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%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （5）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%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）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%；
- （10）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%；
- （11）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%；
- （12）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。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，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%；
- （15）法律法规、中国证监会规定的其他比例限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

### （九）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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 10 个工作日内进行调整。

### （十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 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，保护基金投资者的利益；
- 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，保护基金投资者的利益。

### （十一）基金的投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 4 月 18 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 2016 年 3 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

#### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	377,835,717.48	67.85

	其中：股票	377,835,717.48	67.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	1,844,987.87	0.33
	资产支持证券	1,844,987.87	0.33
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	135,364,970.87	24.31
7	其他资产	41,852,802.33	7.52
8	合计	556,898,478.55	100.00

## （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19,975,742.78	3.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	255,345,447.33	46.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,236,588.02	3.68
E	建筑业	15,799,085.00	2.87
F	批发和零售业	37,369,957.00	6.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,108,897.35	5.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	377,835,717.48	68.75

注：以上行业分类以 2016 年 3 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	1,159,747	25,595,616.29	4.66
2	000920	南方汇通	1,324,189	24,457,770.83	4.45
3	601012	隆基股份	1,883,700	23,828,805.00	4.34
4	600351	亚宝药业	1,892,680	21,292,650.00	3.87
5	601199	江南水务	1,135,611	20,236,588.02	3.68
6	000998	隆平高科	1,101,806	19,975,742.78	3.63
7	002308	威创股份	1,134,800	19,779,564.00	3.60
8	300322	硕贝德	1,318,149	19,693,146.06	3.58
9	000705	浙江震元	1,464,800	18,207,464.00	3.31
10	002630	华西能源	1,660,020	18,144,018.60	3.30

### (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,844,987.87	0.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,844,987.87	0.34

### (五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113010	江南转债	18,450	1,844,987.87	0.34

### (六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

(1) 该基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票未超出该基金的基金合同规定的投资范围。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	531,288.49
2	应收证券清算款	41,270,814.36
3	应收股利	-
4	应收利息	49,909.26
5	应收申购款	790.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,852,802.33

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000920	南方汇通	24,457,770.83	4.45	资产重组

## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年3月31日。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。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。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起-2013年12月31日	0.75%	1.00%	-5.64%	1.02%	6.39%	-0.02%
2014年1月1日-2014年12月31日	34.86%	1.02%	40.83%	0.91%	-5.97%	0.11%
2015年1月1日-2015年12月31日	18.68%	2.07%	7.73%	1.86%	10.95%	0.21%
2016年1月1日-2016年3月31日	-13.75%	2.66%	-9.95%	1.82%	-3.80%	0.84%
自基金合同生效起-2016年3月31日	39.08%	1.61%	28.92%	1.40%	10.16%	0.21%

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴存的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、股票投资及其估值调整；
- 6、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 7、其他投资及其估值调整；
- 8、其他资产等。

### （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。基金投资形成的存放或存管在基金托管人以外机构，由基金托管人以外机构实际有效控制的资产，基金托管人的保管职责仅限于保管权利行使依据。

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、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。

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

### （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、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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



（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、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。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人不承担由此造成的损失。

## （五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金

份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### （七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易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、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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净值予以公布。

## 十四、基金的收益分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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、分配方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信

息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2、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。

3、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理费

本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

基金管理人的管理费逐日计提，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，基金托管人复核确认后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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，逐日累计至每个月月末，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15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本章第（一）节中第3至第8项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

### （五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。



## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 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、基金管理人和基金托管人应各自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、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经通报基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 十七、基金的信息披露

### （一）披露原则

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、业务规则及其他有关规定。

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中国证监会指定的报刊和网站披露，并保证投资人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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （二）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媒体上。

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。

### **（三）基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告**

基金合同生效之日起两个月内，基金管理人每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金合同生效之日起两个月后，基金管理人应当在每个市场交易日的次日，通过基金管理人网站、深交所行情系统、以及其他方式，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金资产净值每周至少公告一次。

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款规定的市场交易日的次日，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媒体上。

### **（四）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 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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、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百分之五十；
- 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百分之三十；
- 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百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、更换基金注册登记机构；
- 20、基金暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、基金份额折算与变更登记；
- 27、基金推出新业务或服务；
- 28、中国证监会规定的其他重大事项。

## （五）澄清公告

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。

#### （六）中国证监会规定的其他信息

#### （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、基金托管人和基金份额发售机构的住所，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复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十八、风险揭示

### （一）系统性风险

本基金投资于证券市场，系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险和购买力风险等。

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场及债券市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

#### 4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

#### 5、汇率风险

汇率的变动可能会影响基金投资标的的价格和基金资产的实际购买力。

#### 6、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

#### 7、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升带来的价格风险互为消长。

## （二）非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

### 1、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使基金投资收益下降。本基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

### 2、信用风险

信用风险指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

## （三）基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

### 1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。

### 2、交易风险

在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

### 3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

### 4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

## 5、流动性风险

本基金可能因为暂时未达到上市条件而不能上市交易造成的风险。

### （四）本基金的特定风险

本基金作为混合型基金，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。基金虽然通过规范的价值分析手段投资于价值被低估的股票，但并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完全保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

### （五）上市开放式基金（LOF）交易风险

本基金属于在交易所挂牌交易的上市开放式基金（LOF），基金价格受到供求关系的影响。我国证券市场正处于成长阶段，市场仍存在较多投机行为，投资者心理不稳定，因此可能能使本基金份额市场交易价格同基金份额净值在某些时候出现较大背离，从而有可能直接或间接地对投资者造成损失。

### （六）其他风险

主要是由其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等有可能导致基金财产损失或影响基金收益水平。



## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更涉及本基金基金合同第九条第（二）款规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。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。

2、除上述第1项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在2日内由基金管理人进行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，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、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、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形。

### （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）自出现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、基金注册登记机构、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） 基金清算组作出清算报告；
- （6） 会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7） 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （8） 将基金清算报告报中国证监会备案；
- （9） 公布基金清算公告；
- （10） 对基金剩余财产进行分配。

### 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

基金财产按如下顺序进行清偿：

- （1） 支付基金财产清算费用；
- （2） 缴纳基金所欠税款；
- （3） 清偿基金债务；
- （4） 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算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、基金合同的内容摘要

### 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) 自本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；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；
- 4) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- 5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取申购费及其它法律法规规定的费用；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，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) 按照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；
- 9) 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；
- 10) 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；
- 11) 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；
- 12) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 13) 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；
- 14) 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；
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、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事宜；

2) 办理基金备案手续；

3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

5) 配备足够的专业人员办理基金份额的申购等业务；

6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

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

9) 接受基金托管人依法进行的监督；

10) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值；

11) 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；

12) 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；

13) 按基金合同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；

14) 按照法律法规和本基金合同的规定及时、足额支付分红款项；

15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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

17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

19) 编制季度、半年度和年度基金报告；

20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

21) 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；

22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

23) 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；

24) 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；

25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

26) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损基金份额持有人的利益及资源分配；

27) 以基金管理人的名义，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；

28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### **3、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，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

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) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理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) 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) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，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) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7) 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；

8) 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；

9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

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，还应说明基金托管人是否采取了

适当的措施；

12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

13) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

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款项；

16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法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) 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；

19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

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

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

22) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

23) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### **(3) 基金份额持有人的权益与义务**

基金投资人购买或通过其他合法方式持有本基金基金份额的行为即视为对本基金合同的承认和接受，基金投资人自依据本基金合同、招募说明书取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### **(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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

## **(2) 基金份额持有人的义务**

- 1) 遵守基金合同;
- 2) 缴纳基金申购、赎回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) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、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召集、议事及表决的程序和规则**

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基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同;
- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 更换基金托管人;



- （4）更换基金管理人；
- （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据本基金合同相关规定和法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （6）本基金与其它基金的合并；
- （7）变更基金类别；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

### 3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率；
- （3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （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。

### 4、召集人和召集方式

（1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

（3）代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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（含 10%）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基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

（6）基金份额持有人会议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、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

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

## 6、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式或法律法规和中国证监会允许的其他方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但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。

## 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

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

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但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。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 7、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

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

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

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

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

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

4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 未获基金份额持有人大会审议通过, 就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议, 其时间间隔不少于 6 个月。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案, 应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后在公证机关监督下进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名

(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## 2) 通讯方式开会

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

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下列项规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

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

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 9、计票

### (1) 现场开会

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

持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

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

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

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

## （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。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

（3）基金份额持有人大会决议应自核准或备案后2日内在指定媒体公告。

## （三）基金投资范围和比例限制

### 1、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，包括国内依法发行上

市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

## 2、投资禁止行为与比例限制

### 1、投资禁止行为

禁止用本基金财产从事以下行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、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。

### 2、投资组合比例限制

- 1) 本基金股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；
- 2) 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；
- 3) 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%；
- 4) 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%；

5) 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%；

6) 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%；

7) 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%；

8) 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%；

9) 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%；

10) 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%；

11) 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%；

12) 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。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，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%；

15) 法律法规、中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

### 3、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 10 个工作日内进行调整。

#### （四）基金合同的终止的事由与程序

1、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的；
- （2）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、新基金托管人承接的；
- （3）基金合同约定的其他情形。

2、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算组

1）自出现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、基金注册登记机构、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）基金清算组作出清算报告；
- 6）会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8）将基金清算报告报中国证监会备案；

- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### （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

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （6）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算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。

### （五）争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

### （六）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复

制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 18 层

法定代表人：许会斌

成立时间：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158 号文

注册资本：2 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

电话：010-66228888

传真：010-66228889

联系人：路彩营

#### 2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：胡怀邦

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：618.85 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

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、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，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

### 2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- （1）本基金股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；
- （2）持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；
- （3）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%；
- （4）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%；

- （5）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%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）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%；
- （10）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%；
- （11）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%；
- （12）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。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，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%；
- （15）法律法规、监管部门规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制，并相应修改限制规定。

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 10 个工作日内进行调整。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的基金投融资比例限制的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

**3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。**

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、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。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，《基金合同》生效后 2 个工作日内，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者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人有以上投资禁止行为的，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。



#### **4、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。**

（1）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，基金托管人于收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人电话或书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

（2）基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

#### **5、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。**

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，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，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（3）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、

复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（4）基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

6、基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

7、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认、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行为进行监督和核查。

8、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，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。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，并通知基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在 10 个工作日内，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。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，

同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、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。

**9、基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。**

#### **（四）基金财产的保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金托管人应安全保管基金财产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

（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和独立。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产，对存放或存管在第三方机构并处在第三方实际控制下的托管资产，基金托管人仅限于保管托管资产的行使依据或权利证明；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

##### **2、基金的银行存款账户的更名和管理**

（1）基金托管人应负责建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）银行存款账户的更名和管理。

（2）基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户或依据监管部门批复对原资金账户进行更名，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，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基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

（4）基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

（5）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理的有关规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

（6）基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

### **3、基金证券账户、资金账户的更名和管理**

基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司依据监管部门批复对原证券账户进行更名。

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和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立

结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。

基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### **4、债券托管账户的开立和管理**

（1）基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。

（2）基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### **5、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管**

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入注册登记机构的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。存放于基金托管人处属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### **6、与基金财产有关的重大合同的保管**

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，并在收到合同正本后 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。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## （五）基金资产净值计算与复核

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基金总份额总数的数值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人将基金份额净值予以公布。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。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

本基金按以下方法估值：

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术

难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、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。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人不承担由此造成的损失。

#### **（六）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金管理人可委托基金注册登记机构登记和保管基金份额持有人名册。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、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金托管人应根据基金管理人的要求定期或不定期向基金管理人提供基金份额持有人名册。

基金管理人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

### （七）争议解决方式

本协议双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

### （八）托管协议的修改与终止

#### 1、基金托管协议的变更

本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会核准或备案。

#### 2、基金托管协议的终止

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或



因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。公司承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，积极增加服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

（一）客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）、010-66228000

### 1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金净值查询、账户信息查询、公司信息查询、基金信息查询等。

### 2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至每周五，上午 9：00～17：00 的人工电话咨询服务。

### 3、客户留言服务

投资者可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知公司客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

（二）订制对账单服务

投资者可以通过本公司客户服务电话、电子邮箱、传真、信件等方式订制对账单服务。本公司在准确获得投资者邮寄地址、手机号码及电子邮箱的前提下，将为已订制账单服务的投资者提供电子邮件、短信和纸质对账单：

### 1、电子邮件对账单

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的持有人发送电子对账单。

### 2、短信对账单

短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额

市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信对账单服务的持有人发送短信对账单。

### 3、纸质对账单

纸质对账单是通过平信向基金份额持有人提供份额对账的一种账单形式。纸质对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。我公司在每季度或年度结束后的 15 个工作日内向预留了准确邮寄地址并成功订制纸质对账单服务的持有人寄送纸质对账单。

### 4、对账单补寄

投资者提出补寄需求后，我公司将于 15 个工作日内安排寄出。

## （三）网站服务（www.ccbfund.cn）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、公司动态及相关信息等。

2、账户查询：投资者可通过网上“账户查询”服务查询账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资者还可通过“账户查询修改”、“查询密码修改”自助修改基本信息及查询密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷的下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好的了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资者的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

## （四）短信服务

若投资者准确完整的预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆公司网站添加后定制此项服务。

## （五）电子邮件服务

若投资者准确完整的预留了电子邮箱地址，可获得免费电子邮件服务，包括产品信息、公司最新公告等。未预留电子邮箱地址的投资者可拨打客服

电话或登录公司网站添加后订制此项服务。

#### （六）微信、易信服务

我公司通过官方微信、易信等即时通讯服务平台为投资者提供理财资讯及基金信息查询等服务。投资者可在微信、易信中搜索“建信基金”或者“ccbfund”添加关注。

投资者通过公司官方微信、易信可查询基金净值、产品信息、分红信息、理财资讯等内容。已开立建信基金账户的投资者，将微信、易信账号与基金账号绑定后可查询基金份额、交易明细等信息。

#### （七）密码解锁/重置服务

为保证投资者账户信息安全，当拨打客服电话或登陆公司网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达6次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

#### （八）客户建议、投诉处理

投资者可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信、传真等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

## 二十三、其他应披露事项

自 2015 年 9 月 19 日至 2016 年 3 月 18 日，本基金的临时公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-02-05
2	关于乐融多源投资咨询有限公司代销建信基金管理有限公司产品的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-01-11
3	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行基金定投业务费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015-12-14
4	关于旗下基金产品参加“京东全场基金 0 折购”活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015-12-02
5	关于新增上海陆金所资产管理有限公司为建信双利策略主题分级基金等多只产品代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2015-11-26
6	关于新增富济财富为建信双利策略主题分级股票型证券投资基金等多只产品代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2015-11-10
7	关于建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2015-09-29

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 查阅上述公告。

## 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

- 1、《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 2、《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 5、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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。

本页无正文，为《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》签章页。

建信基金管理有限责任公司

二〇一六年五月七日