

通乾证券投资基金招募说明书

基金发起人：河北证券有限责任公司
陕西省国际信托投资股份有限公司
融通基金管理有限公司

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行

重要提示

发起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审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均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。

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，也不保证最低收益。

	发行价格	面值	发行费用	募集资金
每份基金单位(元)	1.01	1.00	0.01	1.00
合计(亿元)	20.2	20	0.2	20

基金类型：契约型封闭式；存续期为 15 年

投资目标：通过价值成长型投资实现基金资产的稳定增长

基金单位发行份额：20 亿份

基金单位面值：1.00 元人民币

基金单位每份发行价格：1.01 元，其中 0.01 元为发行费

募集资金：20 亿元人民币

发行对象：中华人民共和国境内自然人和法人

(法律、法规及有关规定的禁止购买者除外)

发行方式：上网定价发行与网下发行相结合

发行协调人：中信证券股份有限公司

上网定价发行时间：2001 年 8 月 23 日

网下发行缴款截止日：2001 年 8 月 24 日

交易安排：发行成功后将申请在上海证券交易所上市

基金发起人：河北证券有限责任公司
陕西省国际信托投资股份有限公司
融通基金管理有限公司

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行

签署日期：2001 年 8 月 16 日

一、绪言

本招募说明书依据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则等有关法规以及《通乾证券投资基金基金契约》编写而成；全体发起人已批准本招募说明书，确信其中不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

本基金单位是根据本招募说明书所载明的资料申请发行的。本基金发起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。

二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：指通乾证券投资基金

《基金契约》：指《通乾证券投资基金基金契约》

《暂行办法》：指《证券投资基金管理暂行办法》

本招募说明书：指《通乾证券投资基金招募说明书》

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

基金发起人：指河北证券有限责任公司、陕西省国际信托投资股份有限公司、融通基金管理有限公司

基金管理人：指融通基金管理有限公司

基金托管人：指中国建设银行

基金持有人：指本基金单位持有人

三、基金设立

（一）基金设立的依据

本基金由发起人依照《暂行办法》、《基金契约》及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字【2001】第 25 号文批准发起设立。

（二）基金存续期间及基金类型

本基金存续期为 15 年，类型为契约型封闭式。

（三）基金发起人认购及持有情况

基金发起人认购基金单位总份额的 1%，即 2000 万份，其中：河北证券有限责任公司认购 500 万份，占基金单位总份额的 0.25%；陕西省国际信托投资股份有限公司认购 500 万份，占基金单位总份额的 0.25%；融通基金管理有限公司认购 1000 万份，占基金单位总份额的 0.5%。

本基金发起人认购的基金单位，自基金成立之日起一年内不得转让。一年以后，在本基金存续期间，全体基金发起人持有的基金单位合计不得低于基金单位总份额的 0.5%，即 1000 万份，其中：河北证券有限责任公司应持有 250 万份，占基金单位总份额的 0.125%；陕西省国际信托投资股份有限公司应持有 250 万份，占基金单位总份额的 0.125%；融通基金管理有限公司应持有 500 万份，占基金单位总份额的 0.25%。

（四）基金契约

基金契约是约定本基金当事人权利、义务的法律文件。基金投资者自取得依本基金契约所发行的基金单位，即成为基金持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对本基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、本基金契约及有关规定享有权利、承担义务。

基金投资者欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅《通乾证券投资基金基金契约》。

四、本次发行有关当事人

（一）基金发起人

1、河北证券有限责任公司

注册地址：石家庄市裕华东路 81 号

注册资本：53925 万元人民币

法定代表人：武铁锁

联系电话：0311—6081028

传真：0311—6982188

联系人：王增茂

2、陕西省国际信托投资股份有限公司

注册地址：陕西省西安市环城东路南段 8 号

注册资本：31419 万元人民币

法人代表：孙志诚

联系电话：029—3233888 转 226 房间

传真：029—3239456

联系人：姚卫东

3、融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区民田路 10 号中海大厦 6、7、8 层

注册资本：1.25 亿元人民币

法定代表人：孟立坤

联系电话：0755—2550609，2550676

传真：0755—2550383

联系人：李超 付浩

(二) 基金发行协调人

中信证券股份有限公司

法人代表：常振明

注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦三层

联系电话：010—64661490

传真：010—84868313

联系人：杨宇翔 周钢

(三) 律师事务所和经办律师

康达律师事务所

法定代表人：傅洋

地 址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室

联系人：娄爱东 杜玉兰

电 话：010—85262828

传 真：010—85262826

经办律师：娄爱东 杜玉兰

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

安永华明会计师事务所

地 址：北京市朝阳区门北大街 6 号北海万泰大厦 802—807

法定代表人：葛明

联系人：罗国基

电 话：010—65545577

传 真：010—65544718

经办注册会计师：葛明、金馨

五、发行安排

(一) 发行方式：上网定价发行与网下发行相结合

(二) 发行时间：上网定价发行日期为 2001 年 8 月 23 日，网下发行部分商业保险公司和商业保险公司以外的法人（以下简称“一般法人”）的缴款截止日为 2001 年 8 月 24 日。如遇重大突发事件影响本基金发行，经中国证监会同意后，可在下一个工作日顺延申购和缴款。

(三) 发行对象：中华人民共和国境内自然人和法人（法律、法规及有关规定禁止购买者除外）。

(四) 发行规模：20 亿份基金单位。其中：发起人认购 2000 万份；以不超过基金单位总份额的 30%，即 6 亿份，向商业保险公司配售；余下 13.8 亿份基金单位向自然人和一般法人发行，其中，向自然人上网定价发行的预定份额为 9.8 亿份基金单位，向一般法人网下发行的预定份额为 4 亿份基金单位，并将根据实际发行情况以不超过本次发行总份额的 20%，即 4 亿份基金单位进行双向回拨。本次发行数量的具体情况，详见 2001 年 8 月 20 日刊登的基金发行公告。

(五) 发行价格：每份基金单位 1.01 元，其中：面值 1.00 元，发行费用 0.01 元。

(六) 上网定价发行部分基金单位认购的最低限额为 1000 份，认购的份额必须为 1000 份的整数倍；每一帐户不设申购上限，可以重复申购，但每一笔申购委托不得超过 99.9 万份基金单位。网下发行的部分一般法人的最低申购数量为 500 万份，且申购数量必须为 500 万份基金单位的整数倍；申购上限为本次发行总额的 3%，即 6,000 万份基金单位。

六、基金成立

本基金发行期限结束时，如实际募集的资金超过 16 亿元人民币，即超过本基金批准规模的 80%，则本基金依法成立；否则，本基金不成立，基金发起人将承担基金募集费用，已募集的资金并加计当期银行企业活期存款利息将在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。

本基金成立前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不作他用。

七、基金投资

(一) 投资目标

本基金属于价值成长型基金，主要投资于具有一定竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型上市公司股票，同时兼顾价值型公司股票。通过组合投资，在有效分散和控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增长。

(二) 投资理念

我们认为，证券投资的核心在于购买未来。因此，应该以发展的眼光、运用动态市盈率的概念来判断未来，而不是用僵化的静态市盈率来衡量现在。投资时应重点选择那些所在行业发展前景良好、公司销售收入和收益保持较高成长能力的公司，通过参与一个行业或公司的高成长阶段来获取收益，此即成长型投资。

同时，我们认为，从经济学角度讲任何公司都有其相对的内在价值，而在证券市场上企业的内在价值和市场价格又往往存在偏差，但是从长期趋势看市场价格总体上呈现以内在价值为中心、围绕内在价值波动的基本规律，因此通过寻找市场价格和内在价值存在偏差、而且市场价格低于内在价值的公司作为投资对象是从市场获取稳健投资收益的有效途径，此即价值型投资。

从国内外基金运作的实践来看，成长型投资和价值型投资并不矛盾，成功的基金在大多条件下是对两者的有效结合。就我国证券市场而言，经过多年的改革和发展，证券市场已经集中了国内大部分的优秀企业，相当数量的上市公司具有管理、资金、技术和人才等各方面的优势，已成为各行业发展的核心力量，这些公司业绩的持续高速增长将为投资者带来较好的投资收益。同时还有很多上市公司的实际价值未被市场认识或被市场低估、市盈率和市净率水平相对偏低，随着投资者专业化水平和市场效率的不断提高，这些公司的价值必然会被市场发现并实现价值回归。基于这样的考虑，本基金的投资理念定位为价值成长型投资，即通过对成长型和价值型股票的复合型投资，在能够较好地分散和控制风险的前提下争取较高资本利得和相应投资收益，谋求基金资产的稳健高效增值。

(三) 投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其股票投资部分将主要投资于成

长型股票和价值型股票。

(四) 投资组合

1、本基金投资组合的原则

(1) 本基金的投资组合应本着流动性、安全性、收益性的原则，综合宏观经济、行业企业和证券市场的因素，确定投资组合，达到分散和降低投资风险，谋求基金长期稳定增值的目的。

(2) 本基金为价值成长型基金，投资组合主要包括两部分，一部分为成长型投资，另一部分为价值型投资。

成长型投资的上市公司主要选择标准是：

a. 公司所在行业有发展前景，企业处于成长阶段或成熟阶段早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；或

b. 企业主营业务收入和主营业务利润能保持较高的成长性 or 增长潜力；或

c. 公司在市场拓展、产品开发、技术和管理等方面具有相当的竞争优势；或

d. 公司迅速成长，已经具备一定的规模优势，产品市场占有率较高，公司有良好的市场知名度和较好的品牌效应；或

e. 公司管理层开拓进取，具备企业家素质，建立了科学的管理和组织架构。

价值型投资的上市公司的主要选择标准是：

a. 与同行业平均市盈率水平或公司自身的盈利能力相比，市盈率水平偏低；或

b. 公司的价格收益比、价格/重置成本较低，或者有隐蔽性资产；或

c. 公司所具有的某项有形资产或专利、专有技术、品牌、特许权等无形资产的实际价值未被市场认识或被市场低估；或

d. 通过资产重组公司的基本面已经发生巨大改变，但是公司的市场价格还没有完全反映该变化。

(3) 本基金亦部分投资于债券，以调节投资于股票可能带来的收益波动，分散风险，使基金的收益表现更加稳定。

2、本基金的投资组合必须符合以下规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券总股本的 10%；

(4) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；债券回购的资金余额不得超过基金净资产的 40%；

(5) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

(五) 投资策略

1、资产配置策略

在不同的市场趋势下，成长型股票和价值型股票的表现机会不同，一般来说在牛市多头特征明显时，成长型股票孕育更多的机会；而在市道低迷情况下，价值型股票是较好的选择。本基金的资产配置将根据对不同阶段市场行情的基本判断，灵活调整股票投资和国债投资、股票投资中成长型股票和价值型股票的比例，实现资产配置的最优化。其中，在牛市行情中，成长型股票最多可增持至股票投资总额的 80%，相应地，价值型股票可减持到股票投资总额的 20%；反之，在空头市场中，价值型股票最多可增持到股票投资总额的 80%，相应地，成长型股票可减持到股票投资总额的 20%。

2、股票投资策略

在股票投资中，本基金将坚持以下基本策略：

(1) 大盘走势关系基金投资全局，基金投资中将通过对市场趋势、特别是大盘趋势的判断，以及由此决定的基金仓位选择和投资重点放在最优先的位置。

(2) 以价值成长型投资为主导，把企业的内在价值和未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。

(3) 致力于建立完善的数理统计体系，利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路，对市场运行特征进行跟踪，保证基金投资决策的科学性。

(4) 重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

(六) 投资决策

1、决策依据

(1) 国家宏观经济环境；

(2) 国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定；

(3) 货币政策、利率走势；

(4) 地区及行业发展状况；

(5) 上市公司研究；

(6) 证券市场的走势；

2、决策程序

本基金管理人内部设立基金管理部、研究策划部、基金交易部、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会，进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下：

(1) 研究策划部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的依据。

(2) 基金经理根据研究策划部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，作出偏向价值或偏向成长的不同投资取向，形成资产配置提案报投资决策委员会。

(3) 投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

(4) 基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

(5) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部。

(6) 基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(7) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

(七) 投资限制

本基金禁止从事下列行为：

1、投资于其他基金；

2、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

3、从事证券信用交易；

4、以基金资产进行房地产投资；

5、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

6、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

7、运用基金资产进行内幕交易和操纵市场，通过关联交易损害基金持有人的利益；

8、利用基金资产配合管理公司的发起人、所管理基金的发起人及其他任何机构的证券投资业务；

9、故意维持或抬高管理公司发起人、所管理基金的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；

10、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

(八) 基金经理

本基金由基金经理负责基金的日常投资运作，并设基金经理助理协助基金经理工作。

赵枫先生，基金经理，28岁，本科学历。5年证券从业经验，1年基金管理经验。历任中国技术进出口总公司金融部分析员、上海中技投资顾问公司证券投资分析师、鹏华基金管理有限公司研究员。

陶武彬先生，基金经理助理，30岁，硕士学历，4年证券从业经验。先后在深圳市深投投资有限公司、香港京华山一证券公司从事企业财务顾问、上市融资及研究分析工作。

(九) 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，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

八、基金专用交易席位的选用

(一) 选择使用交易席位的证券经营机构的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其专用交易席位。选择的标准是：

- 1、资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- 2、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- 3、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- 4、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- 5、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

6、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

代理证券买卖的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，报证监会备案并公告。

(二) 席位使用期限及更换方式

席位使用期限暂定为半年。使用期满后，基金管理人将根据证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，包括：

- 1、提供的研究报告的数量和质量；
- 2、研究报告被基金采纳的情况；
- 3、因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- 4、因采纳其报告为基金运作避免或减少的损失；
- 5、由基金管理公司提出课题，由证券经营机构提供研究论文；
- 6、开放证券经营机构的资料库。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行评价排名，同时亦关注并接受暂未使用其席位的证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及信息服务不符合管理人的要求,管理人有权提前终止使用其交易席位。

(三) 席位运作方式

根据《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》的要求,基金通过一个证券经营机构买卖证券的年成交量,不得超过本基金买卖证券年成交量的 30%。基金管理人将根据该项规定并结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量,分配基金在各席位买卖证券的交易量。

(四) 其他事宜

融通基金管理有限公司将根据有关规定,在基金中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露,并向中国证监会报告。

九、风险揭示

本基金投资存在的风险主要有:

(一) 市场风险

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

1、政策风险。因国家宏观政策(如货币政策、财政政策、行业政策等)发生变化,导致市场波动而产生的风险。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化,市场的平均收益水平也呈周期性波动,基金所投资证券的收益水平也会随之变化,从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率波动会导致证券市场价格和收益率的变动,其直接影响国债价格和收益率,影响企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票,收益水平亦会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。作为成长型公司,如果经营没有达到预期的良好状况,可能出现成长性不足而导致股票价格下跌或股息、红利减少;作为价值型公司,如果公司基本面情况发生不利变化,原来价格低估的判断可能在重新评判后不复存在,或者因为预期更坏的情况出现都可能使股票价格下跌或股息、红利减少,给基金投资者带来风险。

5、购买力风险。基金的收益主要通过现金的形式来分配,而现金购买力可能因为通货膨胀的影响而下降,导致使基金的实际投资收益下降。

(二) 管理风险

基金管理运作过程中由于管理人的主观因素,会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断,从而影响基金收益水平。

对于成长型投资,由于判断公司能否成为成长型公司一般依据其历史表现,但股票的投资收益主要决定于公司未来实际的成长性和盈利能力,因此用历史表现估计预期收益存在一定的风险。公司实际成长水平与预期成长能力之间的轻微差异,都可能使股票原有的高市盈率无法保持。对于价值型投资,由于价值型投资获利与否的关键在于被投资股票的价值能否实现回归,因此投资价值型股票最大的风险是对公司内在价值判断失误。对于价值成长型基金,还可能因为管理者对证券市场的认识和判断上的偏差,使得成长型和价值型两种投资类型的复合效果逊于单纯的成长型和价值型基金。

同时,本基金管理人管理的基金超过一只,因此本基金在进行具体投资操作时可能会受到其他基金投资所带来的影响。尽管基金管理人内部有严格的交易规则来避免不同基金投资的利益冲突,但无法保证完全避免该影响的产生。

（三）其他风险

基金受其它不可抗力（如战争、自然灾害等）的影响，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

十、基金资产

（一）基金资产总值

基金资产总值包括基金购买的股票、债券和银行存款本息的总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

（三）基金资产的帐户

本基金资产以“通乾证券投资基金专用帐户”的名义开立基金专用银行存款帐户及证券帐户，与基金管理人和基金托管人自有的资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

（四）基金资产的处分

本基金资产独立于管理人和托管人的资产，并由托管人保管。管理人、托管人以其自有的资产承担相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

十一、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

（二）估值日

每日对基金资产进行估值。

（三）估值方法

- 1、上市证券按当日平均价计算；该日无交易的证券，以最近一日的平均价计算；
- 2、未上市的股票以其成本价计算；
- 3、未上市债券及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算；
- 4、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人应依据主管机关的有关规定办理。
- 5、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

（四）估值对象

基金依法拥有的股票、债券和银行存款本息等资产。

（五）估值程序

基金的日常估值由管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按照基金契约规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资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、因其他不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

十二、基金费用

（一）基金费用的种类：

- 1、基金管理人的报酬；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；

- 4、 证券交易费用；
- 5、 基金信息披露费用；
- 6、 基金持有人大会费用；
- 7、 会计师费用和律师费用等。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、 基金管理人的报酬

基金管理人的报酬由两部分组成，一部分是基金管理费，以基金资产净值的 1.5% 年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益率高于同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上，且当年基金资产净值增长率高于同期证券市场平均收益率时，按一定比例计提。

具体计算方法如下：

(1) 基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法为：

$$H = E \times 1.5\% \times 1 \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过 20% 部分的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 业绩报酬

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在满足以下几个基本条件下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

- a. 基金年平均单位资产净值不能低于面值；
- b. 基金可分配净收益率超过同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上；
- c. 基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率；
- d. 基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在满足以上条件的情况下，基金业绩报酬计算方法为：

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后期初资产净值} \times \text{MIN}[M, N] \times 5\%$$

其中 M=基金可分配净收益率 - 1.2 × 同期银行一年定期储蓄存款利率(如果年内利率发生变动, 则按时间段进行加权平均调整)；

N=基金资产净值增长率 - 证券市场平均收益率；

MIN[M, N] 为 M、N 中较小者；

基金可分配净收益率=当期可分配净收益/调整后期初资产净值；

调整后期初资产净值=上年度末基金资产净值 - 上年度已分配收益；

基金资产净值增长率=(期末基金资产净值 - 调整后期初基金资产净值)/调整后期初基金资产净值；

证券市场平均收益率=[(期间深综指涨跌幅 × 深市平均总市值 + 期间沪综指涨跌幅 × 沪市平均总市值) / (深市平均总市值 + 沪市平均总市值)] × 80% + 同期国债收益率 × 20%；

深市平均总市值=(期末深市总市值 + 期初深市总市值)/2；

沪市平均总市值=(期末沪市总市值 + 期初沪市总市值)/2；

业绩报酬每个会计年度末计算，由基金托管人于次个会计年度前 20 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日）由基金托管人从基金资产中一次性支取。

3、上述 3—7 项费用按所签协议或有关规定计算，由基金托管人从基金资产中支付。

（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资产的损失，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。

（四）基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理人报酬和基金托管费，此项调整不需要召开基金持有人大会。

（五）上述基金费用计提方法、计提标准和支付方式因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

十三、基金税收

本基金及本基金持有人依据国家有关规定依法纳税。

十四、基金收益与分配

（一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、收益分配比例不低于基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配采取分派现金方式，每年至少分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、每一基金单位享有同等分配权。
- 6、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

（四）收益分配方案

基金收益方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

十五、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帐本位币，以人民币元为记帐单位；

- 3、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 4、本基金独立建帐、独立核算；
- 5、本基金管理人及托管人各自保留完整的会计帐目、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；
- 6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
- 7、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

（二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计；
- 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和基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人（或托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经托管人（或管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在 5 个工作日内公告。

十六、交易安排

本基金成立之后，将根据《暂行办法》及有关规定，申请在上海证券交易所上市。上市时间拟定为基金发行成功后一个月内。除基金发起人持有的基金份额外，其余基金份额将在基金上市日起开始流通。

十七、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《暂行办法》、《证券投资基金信息披露指引》、基金契约及其他有关规定。本基金信息披露事项必须在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。

（一）定期报告

定期报告包括年度报告、中期报告、投资组合公告、基金资产净值公告。

1、基金管理人应当在每个基金会计年度结束后 90 日内编制完成年度报告，并刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式五份分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。基金年度报告的格式与内容应符合《年度报告的内容与格式》的规定，其中财务报告须经过审计。

2、基金管理人应当在每个会计年度的前 6 个月结束后 60 日内编制完成中期报告，并刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式五份分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。基金中期报告的格式与内容应符合《中期报告的内容与格式》的规定。

3、投资组合公告每季公布一次，应披露基金投资组合分类比例，及基金投资按市值计算的前十名股票明细。公告截止日后 15 个工作日内，基金管理人应编制完成投资组合公告，经基金托管人复核后予以公告，同时分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。

4、基金资产净值至少每周公告一次。基金管理人应于每次公告截止日后第一个工作日计算并公告基金资产净值及每一基金单位资产净值，同时分别报送中国证监会和上市的证券交易所备案。基金管理人在计算基金资产净值时，基金所持股票应当按照公告截止日当日平均价计算。

在计划分配收益确定后，资产净值应扣除此部分；在基金收益未经审计之前同时公布未扣除与拟扣除计划分配收益的两项净值，收益经审计后仅公布已扣除计划分配收益的净值。

（二）临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当于第一时间报告中国证监会及基金上市的证券交易所，并编制临时报告书，经上市的证券交易所核准后予以公告，同时报中国证监会。

重大事件是指可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件，包括

下列情况：

- 1、基金持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人的董事长、总经理、基金托管人的总经理变动；
- 4、基金管理人的董事一年内变更超过 50%；
- 5、基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更超过 30%；
- 6、基金经理变更；
- 7、基金管理人或基金托管人受到重大处罚；
- 8、重大诉讼、仲裁事项；
- 9、基金提前终止；
- 10、基金的扩募、续期或转型；
- 11、其他重要事项。

（三）澄清公告与说明

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的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送中国证监会和基金上市交易的证券交易所。

（四）信息事务管理

- 1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息事务。
- 2、基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向基金管理人出具书面文件。
- 3、上市公告书、年度报告、中期报告在编制完成后，应放置于基金管理人所在地、基金托管人所在地、上市交易的证券交易所、有关销售机构及其网点，供公众查阅。

十八、基金持有人

（一）基金持有人的权利与义务

1、基金持有人权利

- （1）出席或者委派代表出席基金持有人大会；
- （2）取得基金收益；
- （3）监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料；
- （4）转让基金单位；
- （5）取得基金清算后的剩余资产；
- （6）基金契约规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

2、基金持有人义务

- （1）遵守基金契约；
- （2）交纳基金认购款项及规定的费用；
- （3）承担基金亏损或者终止时的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动。

（二）基金持有人大会

1、召开事由

有以下情形之一的，召开基金持有人大会：

- （1）修改基金契约；
- （2）提前终止基金；
- （3）更换基金管理人；
- （4）更换基金托管人；

- (5) 延长基金期限；
- (6) 变更基金类型；
- (7) 中国证监会规定的其他情形。

2、召集方式

- (1) 在正常情况下，基金持有人大会由基金管理人召集；
- (2) 在更换基金管理人或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集基金持有人大会；
- (3) 在基金管理人和基金托管人均无法行使召集权的情况下，由本基金发起人召集基金持有人大会。

3、通知

召开基金持有人大会，召集人于会议召开前 10 天，在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。基金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；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 权利登记日；
- (4) 投票代理委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

4、出席方式

- (1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以授权委托书委派代表出席；
- (2) 书面开会。如采取书面开会的方式，召集人将事先报请中国证监会同意。书面开会以通讯表决方式进行表决。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容：关系基金持有人利益的重大事项，如修改基金契约、提前终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、延长基金期限、变更基金类型以及召集人认为需提交基金持有人大会讨论的其他事项。

(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，报经中国证监会批准后公告。

在书面开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议，报经中国证监会批准后公告。

6、表决

- (1) 基金持有人所持每份基金单位有一票表决权；
- (2) 基金持有人大会决议须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上通过，但更换基金管理人或托管人应由持有半数以上基金单位的基金持有人通过；
- (3) 基金持有人大会决议对所有基金持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

7、公告

基金持有人大会决议报中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

十九、基金发起人

(一) 基金发起人情况

1、河北证券有限责任公司

法人代表：武铁锁

注册地址：石家庄市裕华东路 81 号

邮政编码：050011

组织形式：有限责任公司

注册资本：53925 万元人民币

成立日期：1995 年 9 月 23 日

经营范围：证券的代理买卖；代理还本付息和分红派息；证券代保管、鉴证；代理登记开户；证券的自营买卖；证券的承销和上市推荐；证券投资咨询和财务顾问业务；资产管理；发起设立证券投资基金和资产管理公司。

财务状况：河北证券有限责任公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

2、陕西省国际信托投资股份有限公司

法人代表：孙志诚

注册地址：陕西省西安市环城东路南段 8 号

邮政编码：710048

组织形式：股份有限公司

注册资本：31419 万元人民币

成立日期：1985 年 1 月 5 日

经营范围：信托存贷款、投资；委托存贷款、投资；房地产投资；有价证券；金融租赁；代理财产保管与处理；代理收付；经济担保和信用见证；经济咨询；中国人民银行和外汇管理局批准经营的其他金融业务。

财务状况：陕西省国际信托投资股份有限公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

3、融通基金管理有限公司

法人代表：孟立坤

注册地址：深圳市福田区民田路 10 号中海大厦 6、7、8 层

邮政编码：518026

组织形式：有限责任公司

注册资本：12500 万元人民币

成立日期：2001 年 5 月 22 日

经营范围：基金管理业务；发起设立基金。

主要股东：河北证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、陕西省国际信托投资股份有限公司、上海爱建信托投资有限责任公司、联合证券有限责任公司

（二）基金发起人的权利与义务

1、基金发起人的权利

- （1）申请设立基金；
- （2）按基金发起人协议书的约定认购基金单位；
- （3）出席或委派代表出席基金持有人大会；
- （4）取得基金收益；
- （5）依法转让基金单位；
- （6）监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料；
- （7）参与基金清算，取得基金清算后的剩余资产；
- （8）法律、法规认可的其他权利。

2、基金发起人的义务

- （1）按基金发起人协议书规定的认购比例及数额在募集期间以现金缴纳基金认购数额及规定的费用；
- （2）在基金设立时认购和在存续期间持有符合规定比例的基金单位；
- （3）遵守基金契约；
- （4）承担基金亏损或者终止时的有限责任；
- （5）不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；

- (6) 基金不能成立时及时退还所募集资金本息和按比例承担费用；
- (7) 法律、法规规定的其他义务。

二十、基金管理人

(一) 基金管理人情况

1、名称：融通基金管理有限公司

2、设立日期：2001年5月22日

3、法定代表人：孟立坤

4、注册资本：12500万元人民币

5、注册地址：深圳市福田区民田路10号中海大厦6,7,8层

6、设立概况：由河北证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、陕西省国际信托投资股份有限公司、上海爱建信托有限责任公司、联合证券有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字【2001】8号文批准成立。

7、主要人员情况：

董事长孟立坤先生，1962年生，中共党员，工学博士。1995年至今，就职于河北证券有限责任公司，历任北京营业部总经理、公司总裁助理（副总裁级）。

董事刘承运先生，1947年生，中共党员，大专文化程度，高级经济师，1996年7月至今任陕西省国际信托投资股份有限公司总经理、副董事长。

董事沈国兴先生，1964年生，硕士研究生，现任联合证券有限责任公司副董事长。历任四通集团总裁金融办公室主任、四通集团财务公司总经理、四通集团高科技股份有限公司总裁兼董事；1996年至今，任四通集团公司副总裁、执行副总裁，联合证券有限责任公司副董事长。

董事虞启斌先生，1965年生，博士研究生，现任国泰君安证券股份有限公司副总裁兼资产委托管理总部总监。历任君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、君安证券有限公司香港公司研究策划部经理、君安证券有限公司研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、君安证券有限公司副总裁，2000年至今，任国泰君安证券股份有限公司副总裁兼资产委托管理总部总监。

董事李晓良先生，1966年生，中共党员，研究生在读，现任上海爱建信托投资有限责任公司总经理助理。历任湖南省湘银实验银行理事兼总会计师、珊瑚办事处副行长、长沙市商业银行湘银支行行长兼党支部书记，2000年11月至今，任上海爱建信托投资有限责任公司总经理助理。

独立董事孙潭镇先生，1960年生，中共党员，经济学博士，教授，博士生导师。历任中国社会科学院研究员、中国社科院农村发展研究所宏观管理研究室主任、金鹏期货经纪有限公司常务副总裁、上海亚通股份有限公司执行董事。

独立董事林义相先生，1964年生，经济学博士。历任中国证券监督管理委员会研究信息部副主任、证券交易监控系统负责人，华夏证券有限公司副总裁、华夏证券研究所有限责任公司董事长兼总经理，1997年以来，任瀚蓝投资顾问公司（中英合资）董事长，1999年7月任深圳市创新科技投资公司筹备总顾问，现任该公司独立董事。

独立董事曹凤歧先生，1945年生，教授、博士生导师，现任北京大学金融与证券研究中心主任、北京大学企业管理案例研究中心主任、全国MBA教育指导委员会委员、投资基金立法法工作组副组长、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。

独立董事强力（曾用名强亚利）先生，1961年生，现任西北政法学院教授、法学二系（经济法系）副主任、经济法硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

监事李文方先生，1968年生，大学本科。1993年5月至今就职于河北省证券公司，历

任公司驻上交所交易员、交易部副总经理、总裁助理等职。

监事程燕春先生，1966年生，大学本科，高级经济师，具有12年金融从业经验。长期在中国建设银行工作，历任中国建设银行南昌市城东支行副行长、中国建设银行总行监察室案件检查处正科级监察员、中国建设银行基金托管部市场处负责人、监管处负责人、信息披露负责人。

董事、总经理冯立新先生，1963年生，中共党员，经济学学士，在读博士生。曾就职于财政部、中国人民银行总行，历任中农信公司基金部淄博基金董事会秘书、资金处负责人；1993年至今任职于深圳证券交易所，历任信息部副经理、市场监察部经理、市场监察副总监、上市部总监。

董事、副总经理吕秋梅女士，1963年生，中共党员，工商管理硕士。曾就职于中国人民银行总行，历任国信证券有限公司总裁助理、鹏华基金管理有限公司副总经理。

副总经理张涵先生，1964年生，大学本科，具有10年证券投资经验。历任深圳蛇口招商港务股份有限公司证券部经理、中国技术进出口总公司金融部副总经理、上海投资顾问有限公司总经理、国信证券有限公司基金部负责人、鹏华基金管理有限公司总经理助理兼基金管理部总监、基金普惠基金经理。

督察员吴治平先生，1962年生，硕士，经济师，具有9年证券从业经验。曾在中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部工作，历任深圳市安信财务顾问有限公司部门经理、华夏证券深圳分公司部门经理、国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理、鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金普惠基金经理助理。

8、部门设置及人员情况

融通基金管理有限公司主要设立以下业务部门：监察稽核部、市场拓展部、研究策划部、基金管理部、基金交易部、基金清算部、信息技术部和综合管理部；此外，还设有投资决策委员会和风险控制委员会。

(1) 投资决策委员会

由公司总经理、副总经理、基金经理、研究策划部总监、基金交易部总监及相关人员组成，其主要职责是依据基金管理部和研究策划部所提供的信息与调查研究结论制定基金投资的原则与方向，确定股票、债券、现金资产的投资比例，最终确定投资组合，同时投资决策委员会负责各基金之间的投资协调工作。

(2) 风险控制委员会

由公司董事长、总经理、非分管投资的副总经理、督察员、研究策划部总监、监察稽核部总监、信息技术部总监等组成，其主要职责是负责基金投资过程中的风险评估与防范，制定控制基金投资风险的措施，并在市场发生重大变化的情况下，依据风险控制的要求对投资组合作出有效调整，从而降低投资的风险，保证基金资产的安全。

(3) 基金管理部

下设若干基金管理组，基金管理组由基金经理和基金经理助理组成，负责基金的日常投资运作。基金经理根据研究策划部的投资建议拟订资产配置提案，根据投资决策委员会的投资决策，制定相应的投资组合方案，报投资决策委员会批准后制定具体的操作计划并以投资指令的形式下达至基金交易部。

(4) 研究策划部

主要职能是围绕公司的基金资产管理提供研究信息上的支持并提出投资建议，主要包括各类信息的采集、宏观经济的研究、行业、地区经济的研究、上市公司的深入调研、撰写研究调查报告、提出投资建议，并承担新业务的开发与研究等。

(5) 基金交易部

负责执行各基金管理部的投资指令并将执行结果反馈给各基金经理部。基金交易部的交

易员一般以“时间优先、价格优先”的原则，执行各基金经理下达的交易指令，对由不同基金下达的投资对象相同且价格相近、数量较大的投资指令，由基金交易部负责人协调。在某些特定情况下，基金交易部负责人应提请投资决策委员会协调解决。

(6) 基金清算部

负责基金清算和基金会计核算，主要职责有：与托管行进行业务联系，及时准确地做好基金的会计清算和相关的基金财务报表工作；及时向公司相关部门反映市场交易和基金清算中出现的问题；对基金交易的开户、资金存取调拨以及交易席位的管理；定期编制基金运作报告，编制投资组合报告、基金中报和年报等。

(7) 监察稽核部

监察稽核部独立于公司其他部门，直属总经理领导。其职责是以独立、客观、公正的精神执行内部的监控工作。该部门主要负责制定公司内部各项控制管理制度，检查各部门执行国家有关法律、法规、金融政策情况；检查监督各部门执行公司各项规章制度的情况；审查财务收支的合法性、合规性和合理性；调查内部的经济违法违规案件；审查公司所管理的基金资产的营运情况，进行基金投资风险分析与评价，提出风险控制的方案以供决策部门参考；处理各种风险事项；基金的信息披露工作；总经理授权的其他事项。

(8) 市场拓展部

负责基金新产品开发、市场营销管理、客户服务和公司对外交流。主要职责有：市场的调研及基金新品种的研究和设计；基金品种的宣传策划及营销；基金客户的开发和服务；开放式基金的客户登记与过户；公司的国内、国际交流和合作等。

(9) 信息技术部

为公司正常运转提供信息系统支持，主要职责有：对公司的交易系统、清算系统、资讯系统及公司的办公自动化系统的建立、管理和维护，确保其安全运行；建立及维护公司的公共数据信息平台；设计、建立及维护开放式基金的业务运作系统，并确保其安全运行；制订有关技术系统的突发事件处理程序和应对措施，并组织实施等。

(10) 综合管理部

综合管理部的主要职能有：基金的会计核算和交易清算、公司的财务管理和资金使用计划安排、办公电脑软硬件的配置、维护，交易系统的日常维护、以及人事和劳资管理、文件档案管理、公司后勤保障等。

融通基金管理有限公司现有员工 38 人，其中 82% 以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，71% 以上具有硕士以上学历。所有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。

9、内部风险控制、督察员、监察及稽核、财务及人事管理制度建立情况

建立健全管理公司的规章制度是基金管理公司的基础性工作，也是保护基金投资者的重要措施。除《公司章程》外，融通基金管理有限公司还制定了以下制度：（1）内部风险控制制度

a. 内部风险控制遵循的原则：

全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

风险控制与业务发展同等重要原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和可操作性。

b. 内部风险控制的内容：

内部风险控制制度的内容由一系列的具体制度构成，包括：岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度等。

为保证各部门的相对独立性，应建立明确的岗位分离制度。同时实行空间隔离制度，建立中国墙，充分保证信息的隔离和保密。

各部门应本着合理、高效、尽可能减小错误发生的可能性的原则，制定本部门的作业流程。

基金投资运作实行集中交易制度，建立集中交易室，所有基金投资必须在集中交易室完成。

制定规范的信息披露管理办法，建立完善的信息资料保全系统，建立完整的会计、统计和各种业务资料的档案。

实行独立的稽核检查制度，监察稽核部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

(2) 督察员制度

公司设督察员一人，全权负责监察、稽核公司的内部控制和管理工作。督察员由董事长提名，提交董事会通过。督察员的任免须报中国证监会核准。督察员对董事会负责。

公司督察员可列席公司会议，对公司的各项运作、内部管理、制度执行及遵守法规情况进行内部监察、稽核，每月应独立出具稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

如发现公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和公司董事长报告。

(3) 监察稽核制度

监察稽核部的监察稽核职责：

监察稽核部门依据国家的有关法律法规、公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部负责调查、评价公司有关部门执行国家有关法律法规的情况和执行公司各项规章制度情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；负责调查、评价投资决策与执行情况；评价基金资产情况；负责公司基金经理、财务负责人离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

监察稽核部的监察稽核权限：

监察稽核部有权向有关部门获取文件和材料，查阅合同、协议及相关附件，检查会计凭证、帐册、报表及相关的交易记录资料，核查实物资产；有权穿越公司为控制风险和实施保密制度而设立的有形隔离和无形隔离，亦指通称的防火墙或中国墙；有权要求各业务部门提供有关经营管理计划及其执行情况，提供报表、制度、规定、办法等文件资料。经总经理同意，有权参加公司业务会议；监察公司员工遵守执业行为准则，保密制度的情况，有权要求相关人员提供相关资料和口头或书面说明；监察部对被审部门或个人正在进行的违法、违规行为有权提请被查对象注意，在报公司领导同意后有权予以制止。

(4) 财务管理制度

基金财务与公司财务在管理内容、办法、岗位设置与人员安排上进行严格的区分。财务管理的目的在于有效地提高基金管理的效益，增加公司的资金积累，妥善处理基金持有人与基金管理人、公司和公司股东之间的经济利益关系，提高基金运作和公司经营管理水平，确保基金资产和公司财产安全、完整和增值。主要内容：编制财务计划；管理公司实收资本和营运资金；管理固定资产；管理公积金、公益金；管理公司的经营收入、支出，基金费用的

提取和支付；管理税金解缴、基金收益分配和公司利润分配；制定完善财务制度、负责财务分析、编制财务决算。

(5) 人事管理制度

公司人事制度是为建立正常的经营管理秩序，规范公司员工的行为，提高员工的素质和工作效率，保护员工的正当权利，促进公司的发展，根据国家有关法律法规而制定的。主要内容包括：招收录用，劳动合同，职位设置与职务任免，岗位聘任制度，人事考核，考勤制度，薪资福利，教育与培训，奖惩，辞职与辞退，退休和档案管理等。

10、经营状况

截止 2001 年 8 月 15 日，本基金管理人管理的其他基金仅有一只，其基本情况如下：

(1) 基本情况

基金名称：通宝证券投资基金

基金存续期：10 年，自 1992 年 5 月 31 日至 2002 年 5 月 31 日

基金单位总份额：209,754,000 份

(2) 截止 2001 年 8 月 15 日数据

基金资产净值：201,023,270.37 元

基金单位净值：0.9584 元

(3) 通宝证券投资基金主要由通宝基金经理负责：

郝继伦先生，基金经理，29 岁，经济学博士，5 年证券从业经历。曾在鹏华基金管理有限公司工作，历任研究员和普惠基金经理助理。

(二) 基金管理公司章程摘要

第八条 公司的经营宗旨：根据国家法律、法规及其他有关规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，以专业经营方式管理和运用基金资产，严格自律，竭诚为基金投资人服务，从而使公司稳步、健康发展。

第九条 公司的经营范围为：

- (一) 基金管理业务；
- (二) 发起设立基金。

第十二条 公司股东均以现金出资，各股东的出资额及其占公司注册资本的比例如下：

- 1、河北证券有限责任公司：人民币 2500 万元，占注册资本总额的 20%；
- 2、上海爱建信托投资有限责任公司：人民币 2500 万元，占注册资本总额的 20%；
- 3、陕西省国际信托投资股份有限公司：人民币 2500 万元，占注册资本总额的 20%；
- 4、国泰君安证券股份有限公司：人民币 2500 万元，占注册资本总额的 20%；
- 5、联合证券有限责任公司：人民币 2500 万元，占注册资本总额的 20%。

第二十三条 公司设股东会。股东会由全体股东组成，是公司的最高权力机构。股东会依照《公司法》及本章程行使职权。

第三十二条 公司设立独立董事；公司独立董事须符合下列条件：

- (一) 《公司法》规定的资格条件；
- (二) 不是公司股东单位的任职人员；
- (三) 不是公司当前或以前（三年以内）的任职人员；
- (四) 与公司的其他董事、监事、高级管理人员、督察员、基金经理、财务负责人等没有利益关系；
- (五) 不在与公司存在业务联系或利益关系的机构任职；
- (六) 具有 5 年以上金融、法律或财务方面的工作经验，并有足够的时间和精力履行董事职责；
- (七) 中国证监会根据市场规范和实践的需要规定的其他条件。

第四十三条 公司董事不得有以下行为：

- (一) 直接或间接买卖股票；
- (二) 兼任其他基金管理公司的高级管理人员。

第六十九条 公司设两名监事，监事向股东会负责。经全体监事一致同意，在其成员中推选一名召集人。

第七十八条 公司设总经理一名，副总经理两名，任期为三年，任期届满，可连选连任。董事（除公司董事长外）可以兼任总经理或其他高级管理人员。

总经理对董事会负责，副总经理协助总经理工作。

公司高级管理人员的任职资格须经中国证监会核准。

第八十四条 总经理行使下列职权：

- (一) 主持公司的日常经营、行政及财务的管理工作，组织实施董事会决议；
- (二) 组织实施公司年度经营计划；
- (三) 拟定公司内部管理机构的设置；
- (四) 拟定公司的基本管理制度；
- (五) 制订公司的具体规章制度；
- (六) 拟定公司职工薪酬制度和福利保障方案；
- (七) 提请聘任或者解聘副总经理及公司其他高级管理人员，但须报中国证监会核准；
- (八) 聘任或解聘除应由董事会聘任或者解聘以外的管理人员，决定聘用或辞退工作人员；
- (九) 按照国家法规和公司管理制度，组织对职工的考核、评议，并决定薪酬奖惩、升降级等；
- (十) 在董事会授权范围内代表公司对外处理重要业务；
- (十一) 本章程和董事会授予的其他职权。

第九十二条 公司设督察员一人，全权负责监察、稽核公司的内部控制和管理工作。督察员由董事长提名，提交董事会通过。督察员的任免须报中国证监会核准。督察员对董事会负责。督察员可列席公司的任何会议。

第九十九条 公司不得与任何人订立将公司所管理的基金资产交于该人负责的合同或协议。

(三) 基金管理人的更换

1、有下列情形之一的，经中国证监会批准，可以更换基金管理人：

- (1) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- (2) 基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益；
- (3) 代表 50% 以上基金份额的基金持有人要求基金管理人退任；
- (4) 中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的。

基金管理人的更换程序为：

(1) 提名

基金托管人提名新任基金管理人；

(2) 决议

被提名的新任基金管理人经基金持有人大会通过；

(3) 批准

经中国证监会审查批准后，新任基金管理人方可继任，原任基金管理人方可退任；

(4) 公告

基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

新任基金管理人与原基金管理人办理资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总

值。

（四）基金管理人的禁止行为

基金管理人依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定，诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产，不为自己或任何第三者谋取利益。

基金管理人在管理运作基金资产时，不从事以下行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、从事任何形式的证券承销业务；
- 4、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 5、从事证券信贷业务；
- 6、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7、从事证券信用交易；
- 8、以基金资产进行房地产投资；
- 9、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 10、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关利害关系的公司发行的证券；
- 11、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

（五）基金管理人受处罚情况

本基金管理人无任何受处罚记录。

（六）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

- （1）依法运用基金资产；
- （2）依本基金契约规定获得基金管理人报酬；
- （3）监督托管人。如认为基金托管人违反了本基金契约及国家有关法律法规，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- （4）依照有关规定，代表基金行使股东权利；
- （5）有关法律、法规规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

- （1）自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- （2）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资产；
- （3）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，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- （4）除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
- （5）接受基金托管人的监督；
- （6）按规定计算并公告基金净值及基金单位每份资产净值；
- （7）严格按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- （8）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、基金契约及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不向他人泄露；
- （9）按规定向基金持有人分配基金收益；
- （10）不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- （11）依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定召集基金持有人大会；
- （12）保存基金的会计帐册、报表、记录 15 年以上；
- （13）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(14) 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；

(15) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(16) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

(17) 有关法律、法规规定的其他义务。

(七) 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和直接管理；

2、有利于基金资产的安全和增值；

3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

依照有关规定，基金管理人代表基金出席上市公司的股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

(八) 基金管理人承诺

本基金管理人承诺勤勉尽责、诚实信用、安全有效地管理和运作基金资产，为投资者谋求最大的投资收益。

为切实履行上述承诺，保障投资人合法权益，管理人全体员工均已与公司签定了上岗承诺书，保证不从事任何法律法规及公司禁止的活动。基金经理已作出自律承诺（“基金经理的自律承诺书”见备查文件）。公司任何人员，除为公司进行基金投资外，不得直接或间接进行股票交易；不得协助、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；不得泄露尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。如发现上述行为，公司将根据有关规定进行处罚。

广大投资者如发现本公司员工发生上述行为，请向本公司监察稽核部联系，联系电话：0755 - 2550676

二十一、基金托管人

(一) 基金托管人情况

法定名称：中国建设银行

成立时间：1954年9月9日

注册资本：851亿元

法定代表人：王雪冰

注册地址：北京市西城区金融大街25号

邮政编码：100032

联系电话：010 - 67598381

联系人：胡波飞

发展概况：中国建设银行是我国四大国有商业银行之一，从事我国法律允许商业银行开办的一切金融业务。建设银行始终坚持以效益为中心，以支持经济增长和防范金融风险为重点，强化现代商业银行经营理念和意识，加强管理，规范经营，努力提高资产质量和经营效益。1994年向国有商业银行转轨之后，全行综合性经营能力、竞争能力、风险防范能力和盈利能力大大提高，取得了良好的经济效益。

财务状况：截至2000年末，中国建设银行总资产已达25259亿元，一般性存款余额为19933亿元，贷款余额13796亿元，1999年和2000年分别实现利润74亿元和83亿元。

基金托管部门设置及员工情况：中国建设银行总行于1998年获准设立基金托管部，主要业务部门包括基金市场处、基金清算处、基金核算处、监督稽核处和综合处，在北京、上海和深圳设有基金托管分部。总部员工28人。

主要人员情况：

王雪冰先生，中国建设银行党委书记、行长。历任中国银行美国地区总经理、中国光大

集团总公司副总经理、常务董事、光大银行副董事长、中国银行党组书记、董事长、行长。

陈佐夫先生，中国建设银行基金托管部主管行领导。1997 年进入中国建设银行，此前在高等院校及中央国家机关工作多年。

江先周先生，中国建设银行基金托管部总经理。1986 年进入中国建设银行，历任办公室副主任、国际业务部副总经理。

托管已上市基金的说明：截止 2001 年 7 月 10 日，中国建设银行托管的已上市基金为：

1、基金名称：兴华证券投资基金

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金成立时间：1998 年 4 月 28 日

2、基金名称：泰和证券投资基金

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金成立时间：1999 年 4 月 8 日

3、基金名称：兴和证券投资基金

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金成立时间：1999 年 7 月 14 日

4、基金名称：金鑫证券投资基金

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金成立时间：1999 年 10 月 21 日

5、基金名称：金盛证券投资基金

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金成立时间：2000 年 4 月 26 日

6、基金名称：金鼎证券投资基金

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金成立时间：2000 年 5 月 16 日

7、基金名称：汉博证券投资基金

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金成立时间：2000 年 7 月 12 日

（二）基金托管人的更换

1、更换托管人的条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，更换基金托管人：

- （1）基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- （2）基金管理人认为有充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；
- （3）代表 50% 以上基金份额的基金持有人要求基金托管人退任的；
- （4）中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

基金托管人的更换程序为：

（1）提名

基金管理人提名新任基金托管人；

（2）决议

被提名的新任基金托管人经基金持有人大会通过；

（3）批准

经中国证监会和中国人民银行审查批准后，新任基金托管人方可继任，原任基金托管人方可退任；

（4）公告

基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日

内公告。

新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续,并与基金管理人核对资产总值。

(三) 基金托管人禁止行为

基金托管人按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产和监督基金管理人的运作,不为自己或任何第三人谋取利益。基金托管人不从事以下行为:

- 1、从事基金投资;
- 2、挪用本基金资产;
- 3、在本基金信息公开披露前,向他人泄露有关信息。

(四) 基金托管人受处罚情况

最近三年内基金托管人及其负责基金托管业务的高级管理人员未受到中国证监会、中国人民银行及工商、财税及其他有关机关的处罚。

(五) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依法保管基金的资产;
- (2) 依本基金契约约定获得基金托管费;
- (3) 监督基金管理人的投资运作;
- (4) 法律、法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产;
- (2) 设有专门的基金托管部,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,负责基金资产托管事宜;
- (3) 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,确保基金资产的安全,保证其托管的基金资产与基金托管人资产以及不同的基金资产相互独立;对不同的基金分别设置帐户,独立核算,分帐管理,保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立;
- (4) 除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外,不为自己及任何第三人谋取利益,不委托第三人托管基金资产;
- (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) 以基金的名义设立证券帐户、银行帐户等基金资产帐户,负责基金投资于证券的清算交割,执行基金管理人的投资指令,负责基金名下的资金往来;
- (7) 保守基金商业秘密,除《暂行办法》、基金契约及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不向他人泄露;
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值;
- (9) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告,并上报中国证监会和中国人民银行;
- (10) 建立并保存基金持有人名册,并负责基金单位转让的过户和登记;
- (11) 按有关规定,保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上;
- (12) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对;
- (13) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益;
- (14) 参加基金清算小组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (15) 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中国人民银行,并通知基金管理人;
- (16) 因过错导致基金资产的损失时,承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;

- (17) 基金管理人因过错造成基金资产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- (18) 法律、法规规定的其他义务。

二十二、基金的扩募、续期与转型

(一) 基金的扩募与续期

本基金类型为契约型封闭式, 如果进行扩募或续期, 应当具备下列条件:

- 1、本基金年收益率高于全国证券投资基金平均年收益率;
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为;
- 3、基金持有人大会和基金托管人同意扩募或续期;
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后, 管理人可以向中国证监会申请基金的扩募或在基金存续期满时申请基金的续期, 该申请由中国证监会审查批准。

(二) 基金的转型

基金的转型是指本基金由契约型封闭式转变为契约型开放式, 基金的转型应当具备下列条件:

- 1、本基金管理人(托管人)必须具备管理(托管)开放式基金所必须的人才、技术、设施等必要条件;
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为;
- 3、基金持有人大会同意基金的转型;
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后, 管理人可以在基金存续期内向中国证监会申请基金的转型, 该申请由中国证监会审查批准。

二十三、基金终止

有下列情形之一的, 基金将终止:

- (一) 封闭期满, 未被批准续期的;
- (二) 基金经批准提前终止的;
- (三) 因重大违法、违规行为, 基金被中国证监会责令终止的。

二十四、基金清算

(一) 基金清算小组

1、自基金终止之日起三个工作日内成立清算小组, 基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金清算小组成员由基金发起人、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、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(二) 清算程序

- 1、接管基金资产, 任何人不得处理和处置;
- 2、对基金资产进行清理、核查, 确定基金资产;
- 3、对基金资产进行估价;
- 4、对基金资产进行变现;
- 5、将基金清算结果报告中国证监会;
- 6、公布基金清算报告;
- 7、进行基金剩余资产的分配。

(三) 清算费用

清算费用是指基金清算小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小组从基金资产中支付。

(四) 基金清算剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后,按基金持有人持有的基金单位比例进行分配。

(五) 基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项将及时公告;基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

(六) 清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十五、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

备查文件

- 1、中国证监会证监基金字[2001] 25 号文《关于同意通乾证券投资基金设立及通宝证券投资基金上市、扩募并续期的批复》;
- 2、中国证监会证监基金字[2001] 32 号文《关于改进证券投资基金发行方式有关问题的通知》;
- 3、中国证监会基金部[2001] 44 号文《关于同意通乾基金发行方式调整方案的通知》;
- 4、《通乾证券投资基金基金契约》;
- 5、法律意见书;
- 6、基金发起人的营业执照;
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 9、融通基金管理有限公司高管及投资人员自律承诺书(基金经理)
- 10、中国证监会规定的其他文件。

融通基金管理有限公司

二 〇 〇 一年八月二十日