

华夏行业精选混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)

2016 年第 2 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）由兴安证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2007 年 11 月 13 日证监基金字[2007]314 号文核准的兴安证券投资基金基金份额持有人大会决议，兴安证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）”。自 2007 年 11 月 22 日起，由《兴安证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。根据基金管理人 2015 年 7 月 3 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，华夏行业精选股票型证券投资基金自 2015 年 7 月 15 日起更名为华夏行业精选混合型证券投资基金。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金风险高于货币市场基金、债券基金，属于高风险、高收益的品种。投资有风险，投资者申购基金时，应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 22 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 9 月 30 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

目 录

一、绪言.

.....
..... 1

二、释义.

.....
..... 1

三、基金管理人

.....
..... 6

四、基金托管人

.....
..... 13

五、相关服务机构

.....
..... 15

六、基金的历史沿革

.....
..... 54

七、基金的存续

.....
..... 55

八、基金的集中申购

.....
..... 55

九、基金份额的上市交易

.....
..... 56

十、基金份额的申购、赎回与转换

.....
..... 57

十一、基金的转托管、非交易过户、冻结与质押等业务	67
十二、基金的投资	68
十三、基金的业绩	77
十四、基金的财产	78
十五、基金资产的估值	78
十六、基金的收益与分配	81
十七、基金的费用与税收	82
十八、基金的会计与审计	84
十九、基金的信息披露	85
二十、风险揭示	88
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	90
二十二、基金合同的内容摘要	

.....	92
二十三、基金托管协议的内容摘要	
.....	
.....	103
二十四、对基金份额持有人的服务	
.....	
.....	111
二十五、其他应披露事项	
.....	
.....	113
二十六、招募说明书存放及查阅方式	
.....	
.....	114
二十七、备查文件	
.....	
.....	114

一、绪言

《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）》（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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定以及《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金

合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《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：

基金或本基金：

指华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF），本基金由兴安证券投资基金转型而成。

兴安基金：

指兴安证券投资基金，运作方式为契约型封闭式。

基金合同：

指《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充，本基金合同由《兴安证

券投资基金基金合同》修订而成。

招募说明书：

指《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新。

发售公告：

指基金管理人于 2007 年 11 月 20 日发布的《华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告》。

托管协议：

指《华夏行业精选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，本托管协议由《兴安证券投资基金托管协议》修订而成。

中国证监会：

指中国证券监督管理委员会。

中国银监会：

指中国银行业监督管理委员会。

《基金法》：

指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。

《销售办法》：

指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

《运作办法》：

指《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订。

《信息披露办法》：

指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及其不时做出的修订。

《证券法》：

指《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订。

业务规则：

指深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司共同发布实施的《上市开放式基金业务指引》及代销机构业务规则等相关业务规则和实施细则。

元：

指人民币元。

基金管理人：

指华夏基金管理有限公司。

基金托管人：

指中国银行股份有限公司。

登记结算业务：

指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

登记结算机构：

指办理本基金登记结算业务的机构，本基金的登记结算机构

为中国证券登记结算有限责任公司。

投资者：

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

个人投资者：

指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人。

机构投资者：

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

合格境外机构投资者：

指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者。

基金份额持有人大会：

指按照基金合同第十部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议。

基金转型：

指对 2007 年进行的包括兴安基金由封闭式基金转为上市开放式基金，调整存续

期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)”等一系列事项的统称。

基金合同生效日：

指原《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日。本基金合同自兴安证券投资基金终止上市之日起生效，原《兴安证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

存续期：

指自《兴安证券投资基金基金合同》生效之日起至《华夏行业精选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。

集中申购期：

指基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过1个月。

申购：

指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为。

赎回：

指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合

同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为。

基金转换：

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

投资指令：

指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令。

基金销售：

指对基金申购、赎回、转换等业务（不包括交易）的统称。

场内销售：

指通过深圳证券交易所交易系统办理的基金销售业务。

场外销售：

指不通过深圳证券交易所交易系统，而通过各销售机构柜台系统办理的基金销售业务。

销售机构：

指基金管理人及本基金代销机构。

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。

基金销售网点：

指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点。

指定媒体：

指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站。

深圳证券账户：

指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股股票账户（简称“A股账户”）或证券投资基金账户（简称“基金账户”），投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、申购、赎回等业务时需持有深圳证券账户。

开放式基金账户：

指投资者以深圳证券账户为基础、在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放

式基金账户，投资者办理场外申购、赎回等业务时需具有开放式基金账户。

交易账户：

指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动

及结余情况的账户。

证券登记系统：

指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统。

基金登记系统：

指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，又简称为 TA 系统。

系统内转托管：

指投资者将托管在某场内代销机构（或营业网点）的基金份额转托管到其他场内代销机构（或其他营业网点），或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到其他场外代销机构或基金管理人的行为。

跨系统转托管：

指投资者将托管在某场内代销机构的基金份额转托管到基金管理人或某场外代销机构，或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到某场内代销机构的行为。

工作日：

指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

开放日：

指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。

T 日：

指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期。

T+n 日：

指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日。

基金收益：

指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

基金资产总值：

指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和。

基金资产净值：

指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值：

指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值。

基金资产估值：

指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。

法律法规：

指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于

该等法律法规的不时修改和补充。

不可抗力：

指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发

停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：张静

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位

持股占总股本比例

中信证券股份有限公司

62.2%

山东省农村经济开发投资公司

10%

POWER CORPORATION OF CANADA

10%

青岛海鹏科技投资有限公司

10%

南方工业资产管理有限责任公司

7.8%

合计

100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，中信证券股份有限公司执行董事、总经理，硕士，高级经济师。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中

国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。

沈强先生：董事，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会主任。曾任浙江省国际信托投资公司证券管理总部总经理，金通证券股份有限公司总经理，中信证券（浙江）有限责任公司总经理、党委书记、执行董事，中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会副主任等。

葛小波先生：董事，硕士。中信证券党委委员、董事总经理。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓东先生：董事、总经理，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建设（香港上市）、华夏幸福基业、中海油海洋工程、东兴证券、中兴通讯等五家上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任中华联合人寿保险股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事会理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员，兼任华夏资本管理

有限公司执行董事、总经理。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李一梅女士：副总经理，硕士。兼任上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理，证通股份有限公司董事。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监等。

周璇女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理；曾任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东渤海轮渡股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员，济青高速公路管理局经营财务处副主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部经理，山东高速股份有限公司董事、党委委员、总会

计师。

汪贵华女士：监事，博士。现任华夏基金管理有限公司董事总经理。曾任财政部科研所助理研究员、中关村证券股份有限公司计划资金部总经理、华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司合规部总监。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁、华夏基金管理有限公司法律监察部总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社会记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师。

2、本基金基金经理

孙彬先生，中国人民大学金融学硕士。2007年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任

行业研究员、投资研究部总经理助理、基金经理助理、投资研究部副总监、投资研究部总监、华夏大盘精选证券投资基金基金经理（2013年9月23日至2015年2月27日期间）等，现任华夏基金管理有限公司董事总经理，华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2012年1月12日起任职）。

历任基金经理：2007年11月22日至2012年1月20日期间，罗泽萍女士任基金经理；2012年9月19日至2013年9月23日期间，贺振华先生任基金经理。

兴安证券投资基金历任基金经理：2007年2月14日至2007年11月21日期间，罗泽萍女士任基金经理；2006年5月24日至2007年11月21日期间，刘文动先生任基金经理；2005年12月31日至2006年5月24日期间，蒋征先生任基金经理；2005年8月13日至2006年2月15日期间，张益驰先生任基金经理；2004年9月16日至2005年8月13日期间，程海泳先生任基金经理；2001年11月6日至2004年9月16日期间，王志华先生任基金经理；2000年7月20日至2001年11月6日期间，邹翔先生任基金经理。

3、本公司股票投资决策委员会

主任：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

郑煜女士，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

孙彬先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

郑晓辉先生，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

赵航先生，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

王怡欢女士，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

（四）基金管理人承诺

- 1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。
- 2、本基金管理人不得从事违反《证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。
- 3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不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）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。
 - （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产。

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

5、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利益。

(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(五) 基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1) 公司引入了独立董事制度，目前有独立董事 3 名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2) 公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。

(3) 公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，并进行持续教育。

2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务流程的科学、合理和标准化，并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核；在岗位责任制度上，内部岗位分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置，相互检查、相互制约。

(1) 投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建，基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度，防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例；基金经理小组在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令，对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；交易管理部依据基金经理或基金经理授权的小组成员的指令负责交易执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线，交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定，对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控；风险管理部进行事中

的监控；监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

（2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

（3）技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行，公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

（4）人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

（5）监察制度

公司设立了监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

（6）反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构，指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作；各相关部门设立了反洗钱岗位，配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外，公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程，确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4、信息沟通

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，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，信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化，不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

5、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门，通过定期或不定期检查，评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况，

确保公司各项经营管理活动的有效运行。

6、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) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：010-66594942

中国银行客服电话：95566

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2016年9月30日，中国银行已托管502只证券投资基金，其中境内基金471只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

五、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：李一梅

网址：www.ChinaAMC.com

2、场外代销机构

（1）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：易会满

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：王隼

网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

联系人：客户服务中心

网址：www.abchina.com

(3) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

传真：010-66593777

联系人：客户服务中心

网址：www.boc.cn

客户服务电话：95566

(4) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com

(5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

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

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：张宏革

网址：www.bankcomm.com

客户服务电话：95559

（6）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

（7）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

电话：010-65556689

传真：010-65550827

联系人：方爽

网址：bank.ecitic.com

客户服务电话：95558

（8）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：高天、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（9）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：0591-87839338

传真：0591-87841932

联系人：梁曦

网址：www.cib.com.cn

客户服务电话：95561

（10）中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：唐双宁

电话：010-63636153

传真：010-63639709

联系人：朱红

网址：www.cebbank.com

客户服务电话：95595

（11）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

（12）中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

传真：010-68858117

联系人：陈春林

网址：www.psbc.com

（13）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人：吴建
电话：010-85238670
传真：010-85238680
联系人：李慧
网址：www.hxb.com.cn
客户服务电话：95577

（14）平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路 5047 号
办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号
法定代表人：孙建一
电话：0755-82088888
传真：0755-25841098
联系人：张莉
网址：bank.pingan.com
客户服务电话：95511-3

（15）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路 700 号
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人：陆华裕
电话：0574-89068340
传真：0574-87050024
联系人：胡技勋
网址：www.nbcbb.cn
客户服务电话：962528（北京、上海）、96528（其他地区）

（16）浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号
办公地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号
法定代表人：张达洋
电话：0571-87659546
传真：0571-87659188
联系人：毛真海

网址: www.czbank.com

客户服务电话: 95527

(17) 东莞银行股份有限公司

住所: 东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址: 东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人: 廖玉林

电话: 13316603168

传真: 0769-22117730

联系人: 胡昱

网址: www.dongguanbank.cn

客户服务电话: 0769-96228

(18) 杭州银行股份有限公司

住所: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人: 吴太普

电话: 0571-85108195

传真: 0571-85106576

联系人: 陈振峰

网址: www.hzbank.com.cn

客户服务电话: 400-888-8508

(19) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

住所: 乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址: 乌鲁木齐市新华北路 8 号

法定代表人: 农惠臣

电话: 0991-8824667

传真: 0991-8824667

联系人: 何佳

网址: www.uccb.com.cn

客户服务电话: 0991-96518

(20) 河北银行股份有限公司

住所: 河北省石家庄市平安北大街 28 号

办公地址: 河北省石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人: 乔志强

电话：0311-88627522

传真：0311-88627027

联系人：王栋

网址：www.hebbank.com

客户服务电话：400-612-9999

（21）江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80585939

传真：0519-89995170

联系人：蒋娇

网址：www.jnbank.com.cn

客户服务电话：0519-96005

（22）厦门银行股份有限公司

住所：厦门市湖滨北路 101 号商业银行大厦

办公地址：厦门市湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

电话：0592-5337315

传真：0592-5061952

联系人：许蓉芳

网址：www.xmccb.com

客户服务电话：400-858-8888

（23）泉州银行股份有限公司

住所：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

办公地址：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

电话：0595-22551071

传真：0595-22578871

联系人：董培姗

网址：www.qzccb.com

客户服务电话：400-889-6312

（24）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层
法定代表人：林义相
电话：010-66045529
传真：010-66045518
联系人：尹伶
网址：www.txsec.com
客户服务电话：010-66045678

(25) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层
法定代表人：陈操
电话：010-63130889-8369
传真：010-58325282
联系人：刘宝文
网址：8.jrj.com.cn
客户服务电话：400-850-7771

(26) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人：王莉
电话：021-20835787
传真：010-85657357
联系人：吴卫东
网址：licaikexun.com
客户服务电话：400-920-0022、021-20835588

(27) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼
法定代表人：汪静波
电话：021-38509680
传真：021-38509777
联系人：张裕

网址: www.noah-fund.com

客户服务电话: 400-821-5399

(28) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人: 薛峰

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

联系人: 童彩平

网址: www.zlfund.cn

客户服务电话: 4006-788-887

(29) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人: 其实

电话: 021-54509998-7019

传真: 021-64385308

联系人: 潘世友

网址: www.1234567.com.cn

客户服务电话: 400-181-8188

(30) 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人: 杨文斌

电话: 021-20613635

传真: 021-68596916

联系人: 胡轶隽

网址: www.ehowbuy.com

客户服务电话: 400-700-9665

(31) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 14 层

法定代表人: 陈柏青

电话：18205712248

联系人：韩爱彬

网址：www.antfortune.com

客户服务电话：95188

（32）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

联系人：黄辉

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（33）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818-8653

传真：0571-88910240

联系人：胡璇

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：400-877-3772

（34）北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088-6006

传真：010-62020355

联系人：翟飞飞

网址：www.myfund.com

客户服务电话：400-888-6661

（35）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：400-067-6266

（36）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

网址：www.yixinfund.com

客户服务电话：400-609-9200

（37）众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：王斐

电话：010-59497361

传真：010-64788105

联系人：付少帅

网址：www.wy-fund.com

客户服务电话：400-081-6655

（38）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

电话：13501068175

传真：010-56810630

联系人：马鹏程

网址：www.chtfund.com

客户服务电话：400-898-0618

(39) 深圳宜投基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合
办公楼A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405

法定代表人：华建强

电话：0755-23919681

传真：0755-88603185

联系人：马文静

网址：www.yitfund.com

客户服务电话：400-895-5811

(40) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

传真：010-62680827

联系人：丁向坤

网址：www.fundzone.cn

客户服务电话：400-619-9059

(41) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

网址：www.niuji.net

客户服务电话：400-893-6885

(42) 上海大智慧财富管理有限公司

住所：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层

办公地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层

法定代表人：申健

电话：021-20219536

传真：021-20219923

联系人：王悦伟

网址：www.wg.com.cn

客户服务电话：021-20219931

（43）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

电话：0411-88891212-327

传真：0411-84396536

联系人：姜焕洋

网址：www.haojiyoujijin.com

客户服务电话：400-6411-999

（44）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

办公地址：上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7楼

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323837

联系人：陈云卉

网址：<https://tty.chinapnr.com>

客户服务电话：400-821-3999

（45）北京乐融多源投资咨询有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼2层

法定代表人：董浩

电话：13522549431

传真：010-65951887

联系人：姜颖

网址：www.hongdianfund.com

客户服务电话：400-628-1176

（46）深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室
法定代表人：齐小贺
电话：18938644421
传真：0755-83999926
联系人：马力佳
网址：www.jinqianwo.cn
客户服务电话：0755-83999907

(47) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人：郭坚
电话：021-20665952
传真：021-22066653
联系人：宁博宇
网址：www.lufunds.com
客户服务电话：400-821-9031

(48) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室
办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼
法定代表人：袁顾明
电话：13671788303
传真：021-20324199
联系人：刘璐
网址：www.dtfunds.com
客户服务电话：400-928-2266

(49) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 B1201-1203
法定代表人：肖雯
电话：020-89629021
传真：020-89629011
联系人：吴煜浩

网址: www.yingmi.cn

客户服务电话: 020-89629066

(50) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115-1116室及1307室

法定代表人: TAN YIK KUAN

电话: 0755-89460507

传真: 0755-21674453

联系人: 叶健

网址: www.ifastps.com.cn

客户服务电话: 400-684-0500

(51) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址: 北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人: 钱昊旻

电话: 010-59336519

传真: 010-59336500

联系人: 孙雯

网址: www.jnlc.com

客户服务电话: 4008-909-998

(52) 中信期货有限公司

住所: 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

办公地址: 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

电话: 0755-23953913

传真: 0755-83217421

联系人: 洪诚

网址: www.citicsf.com

客户服务电话: 400-990-8826

(53) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

客户服务电话：95521

（54）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc.com.cn

（55）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

（56）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

(57) 广发证券股份有限公司

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

办公地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

(58) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

(59) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-888-8888

(60) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

客户服务电话：95553、400-888-8001

（61）申万宏源证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李梅

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085599

联系人：钱达琛

网址：www.hysec.com

（62）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

（63）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

（64）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

客户服务电话：400-800-1001

（65）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：400-809-6096

（66）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

联系人：赵小明

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：400-888-1551

（67）万联证券有限责任公司

住所：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：400-888-8133

(68) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

电话：0551-62257012

传真：0551-62272100

联系人：祝丽萍

网址：www.gyzq.com.cn

客户服务电话：95578

(69) 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

传真：022-28451892

联系人：蔡霆

网址：www.ewww.com.cn

客户服务电话：400-651-5988

(70) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

网址：www.htsc.com.cn

客户服务电话：95597

(71) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

客户服务电话：400-666-1618

（72）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

客户服务电话：95548

（73）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

网址：www.dxzq.net.cn

客户服务电话：400-888-8993

（74）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：0512-33396288

（75）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：尹旭航

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（76）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326729

联系人：胡月茹

网址：www.dfzq.com.cn

客户服务电话：95503

（77）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（78）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

联系人：李春芳

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（79）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（80）广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

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

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999-5408

传真：020-88836654

联系人：梁微

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：95396

（81）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：95360

（82）南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

客户服务电话：400-828-5888

传真：025-83364032

联系人：石健

网址：www.njzq.com.cn

（83）上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

网址：www.962518.com

客户服务电话：400-891-8918

（84）新时代证券有限责任公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：田芳芳

网址：www.xsdzq.cn

客户服务电话：400-698-9898

（85）大同证券有限责任公司

住所：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人：董祥

电话：0351-4130322

传真：0351-4192803

联系人：薛津

网址：www.dtsbc.com.cn

客户服务电话：400-712-1212

（86）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：95570

（87）浙商证券股份有限公司

住所：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6-7

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6-7

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

网址：www.stocke.com.cn

客户服务电话：95345

（88）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：谢永林

电话：021-38631117

传真：021-33830395

联系人：石静武

网址：www.pingan.com

客户服务电话：95511-8

（89）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：甘霖

网址：www.hazq.com

客户服务电话：95318、400-809-6518

(90) 国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：95563

(91) 财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

法定代表人：蔡一兵

电话：0731-84403319

传真：0731-4403349

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

客户服务电话：400-883-5316

(92) 东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

电话：0769-22115712、0769-22119348

传真：0769-22119423

联系人：李荣、孙旭

网址：www.dgzq.com.cn

客户服务电话：95328

(93) 中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

电话：0371-69099882

传真：0371-65585899

联系人：程月艳、范春艳

网址：www.ccnew.com

客户服务电话：95377

（94）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人：常喆

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（95）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（96）中银国际证券有限责任公司

住所：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：钱卫

电话：021-50372474

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

网址：www.bocichina.com.cn

客户服务电话：400-620-8888

（97）国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦4层

法定代表人：曾小普

电话：0791-86283080

传真：0791-86281305

联系人：俞驰

网址：www.gsstock.com

客户服务电话：0791-6285337

（98）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-52723273

传真：028-86150040

联系人：谢国梅

网址：www.hx168.com.cn

客户服务电话：400-888-8818

（99）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼
2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼

法定代表人：李季

电话：010-88085258

传真：010-88013605

联系人：唐岚

网址：www.swhysc.com

客户服务电话：400-800-0562

（100）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

联系人：吴阳

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（101）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

客户服务电话：400-832-3000

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

网址：www.csco.com.cn

（102）第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-25831754

传真：0755-23838750

联系人：毛诗莉

网址：www.firstcapital.com.cn

客户服务电话：400-888-1888

（103）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网址：www.jyzq.cn

客户服务电话：400-888-8228

（104）中航证券有限公司

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

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

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

网址：www.scstock.com

客户服务电话：95335

（105）华林证券有限责任公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道 1-1 号君泰国际 B 栋一层 3 号

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 6 楼

法定代表人：林立

电话：0755-83255199

传真：0755-82707700

联系人：胡倩

网址：www.chinalions.com

客户服务电话：400-188-3888

（106）德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

电话：021-68761616-8076

传真：021-68767032

联系人：刘熠

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

（107）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87417129

传真：029-87424426

联系人：刘莹

网址：www.westsecu.com

客户服务电话：95582

（108）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

网址：www.hfzq.com.cn

客户服务电话：0591-96326

（109）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890100

联系人：李昕田

网址：www.hlzqgs.com

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

（110）中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：010-65051166

（111）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967203

传真：021-54967293

联系人：王道

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918

(112) 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15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12层、15层

法定代表人：程宜荪

电话：010-58328112

传真：010-58328748

联系人：牟冲

网址：www.ubssecurities.com

客户服务电话：400-887-8827

(113) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

(114) 中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人：黄扬录

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

客户服务电话：400-102-2011

(115) 西藏东方财富证券股份有限公司

住所：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：www.xzsec.com

客户服务电话：400-881-1177

（116）国融证券股份有限公司

住所：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

电话：010-88086830-730、010-88086830-737

传真：010-66412537

联系人：陈韦杉、朱晓光

网址：www.rxzq.com.cn

客户服务电话：010-88086830

（117）联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119700

联系人：彭莲

网址：www.lxsec.com

客户服务电话：95564

（118）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

联系人：刘爽

网址：www.jhzq.com.cn

客户服务电话：400-666-2288

（119）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

网址：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95310

（120）中国民族证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层

法定代表人：赵大建

电话：010-59355941

传真：010-66553791

联系人：李微

网址：www.e5618.com

客户服务电话：400-889-5618

（121）华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路166号27楼

办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

网址：www.cnhbstock.com

客户服务电话：400-820-9898

（122）长城国瑞证券有限公司

住所：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层

办公地址：福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼

法定代表人：王勇

电话：0592-2079303

传真：0592-2079602

联系人：赵钦

网址：www.gwgsc.com

客户服务电话：400-0099-886

(123) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

法定代表人：钱华

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：王薇

网址：www.ajzq.com

客户服务电话：400-196-2502

(124) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556100

传真：010- 85556153

联系人：李慧灵

网址：www.hrsec.com.cn

客户服务电话：400-898-9999

(125) 天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

电话：027-87618882

传真：027-87618863

联系人：翟璟

网址：www.tfzq.com

客户服务电话：400-800-5000

(126) 宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

电话：028-86199278

传真：028-86199382

联系人：郝俊杰

网址：www.hxzq.cn

客户服务电话：400-836-6366

（127）太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321717、18500505235

传真：010-88321763

联系人：唐昌田

网址：www.tpyzq.com

客户服务电话：400-665-0999

（128）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号一幢二楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

电话：010-88066632

联系人：仲秋玥

客户服务电话：400-817-5666

3、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）。

基金管理人可依据有关法律法规规定，根据情况变化增加或者减少代销机构，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。

（二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-50938870

传真：010-50938907

联系人：陈鸿鹄

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：杨科

经办律师：吴冠雄、杨科

（四）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：上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：许康玮、赵雪

经办注册会计师：许康玮、洪磊

六、基金的历史沿革

华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）由兴安证券投资基金转型而成。

2007 年 10 月 25 日，兴安证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了兴安基金转型议案，内容包括兴安基金由封闭式基金转为上市开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会 2007 年 11 月 13 日证监基金字[2007]314 号文核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请提前终止兴安基金的上市交易，并获得深圳证券交易所深

证复[2007]56 号《关于同意兴安证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意。自 2007 年 11 月 22 日兴安基金终止上市之日，由原《兴安证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏行业精选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，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）”。根据基金管理人 2015 年 7 月 3 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，华夏行业精选股票型证券投资基金自

2015年7月15日起更名为华夏行业精选混合型证券投资基金。

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兴安基金终止上市后，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）基金类型和存续期限

- 1、基金的类别：混合型基金。
- 2、基金的运作方式：契约型上市开放式基金。
- 3、基金存续期限：不定期。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

八、基金的集中申购

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，经中国证监会2007年11月13日证监基金字[2007]314号文批准，自2007年11月27日起向全社会开放集中申购，基金集中申购工作于2007年12月13日结束。

根据《华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告》的相关规定，本次集中申购期申购申请全部确认后本基金资产总规模未超过150亿元，集中申购

期内所有有效申购申请全部予以确认。

本次集中申购有效申购户数为363,538户，按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，本次集中申购有效净申购资金及其产生的利息结转的基金份额共计12,424,077,400.57份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

本基金管理人已于2007年12月19日，即本基金集中申购验资完成日对投资者持有的兴安基金进行了基金份额折算。

经本基金管理人计算并经本基金托管人中国银行股份有限公司确认，基金份额折

算基准日折算前基金资产净值为 1,823,143,906.76 元，原基金兴安的基金份额按照 3.646287813 的折算比例进行折算，折算后基金份额净值为 1.000 元，折算后的基金份额总额为 1,823,143,906 份。

本基金管理人已向登记结算机构提出基金份额的变更登记申请，登记结算机构已于 2007 年 12 月 20 日进行了基金份额的变更登记。

九、基金份额的上市交易

（一）基金在深圳证券交易所的上市

根据有关规定，本基金合同生效后，具备下列上市条件，经向深圳证券交易所申请，于 2008 年 1 月 14 日起在深圳证券交易所上市交易。（交易代码：160314，场内简称：华夏行业）

- 1、基金资产净值不低于 2 亿元。
- 2、基金份额持有人不少于 1000 人。
- 3、深圳证券交易所规定的其他条件。

（二）基金在深圳证券交易所的交易

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》等有关规定，包括但不限于：

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值。
- 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，不足 100 份的部分可以卖出。
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元。
- 5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

（三）基金在深圳证券交易所暂停上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易：

- 1、基金不再具备本条第（一）款规定的上市条件。
- 2、基金违反法律法规，中国证监会决定暂停其上市。
- 3、基金严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的。
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停基金上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所暂停基金上市的决定之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体发布基金暂停上市公告。

当暂停上市情形消除后，基金管理人应向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在至少一种指定媒体发布基金恢复

上市公告。

（四）基金在深圳证券交易所终止上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易：

- 1、基金自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的。
- 2、基金合同终止。
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市。
- 4、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

发生上述终止上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内在至少一种指定媒体发布基金终止上市公告。

十、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购和赎回场所

投资者可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回业务，场内代销机构为基金管理人指定的具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者还可使用开放式基金账户，通过基金管理人直销机构、场外代销机构柜台系统办理申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人直销机构和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务的营

业场所或按基金管理人直销机构和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

1、直销机构

本基金直销机构为本公司北京分公司、上海分公司、深圳分公司、南京分公司、杭州分公司、广州分公司、成都分公司，设在北京、上海、广州的投资理财中心以及电子交易平台。

（1）北京分公司

地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）

电话：010-88087226/27/28

传真：010-88087225

（2）北京海淀投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村南大街11号光大国际大厦一层（100081）

电话：010-68458598/7100/8698/8998

传真：010-68458698

（3）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街 29 号东环广场 B 座一层（100027）

电话：010-64185181/82/83

传真：010-64185180

（4）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路 9 号（新科祥园小区大门口一层）
（100190）

电话：010-82523197/98/99

传真：010-82523196

（5）北京崇文投资理财中心

地址：北京市东城区广渠门内大街 35 号（富贵园购物中心）首层东区 F1-3（100062）

电话：010-67146300/400

传真：010-67133146

（6）北京西三环投资理财中心

地址：北京市海淀区紫竹院路 88 号紫竹花园一期 B 座 01（100089）

电话：010-52723105/06/07

传真：010-52723103

（7）北京亚运村投资理财中心

地址：北京市朝阳区慧忠里 103 号洛克时代广场 A 座一层（100101）

电话：010-84871036/37/38/39

传真：010-84871035

（8）北京朝外大街投资理财中心

地址：北京市朝阳区朝外大街 6 号新城国际 6 号楼 101 号（100020）

电话：010-65336099/6579

传真：010-65336079

（9）北京东四环投资理财中心

地址：北京市朝阳区八里庄西里 100 号 1 幢 103 号（100025）

电话：010-85869585

传真：010-85869575

（10）上海分公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 101A 室（200120）

电话：021-58771599

传真：021-58771998

(11) 上海联洋投资理财中心

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号第一层 101A-1 单元 (200120)

电话：021-68547366

传真：021-68547277

(12) 深圳分公司

地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6001 号太平金融大厦 40 层 02 室

(518038)

电话：0755-82033033/88264716/88264710

传真：0755-82031949

(13) 南京分公司

地址：南京市鼓楼区汉中路 2 号金陵饭店亚太商务楼 30 层 B 区 (210005)

电话：025-84733916/3917/3918

传真：025-84733928

(14) 杭州分公司

地址：杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 105 室 (310007)

电话：0571-89716606/6607/6608/6609

传真：0571-89716611

(15) 广州分公司、广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 50 层 02 单元

(510623)

电话：020-38067290/7291/7293/7299、020-38460001/1058/1079

传真：020-38067232、020-38461077

(16) 成都分公司

地址：成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 1 栋 1 单元 14 层 1406-

1407 号 (610000)

电话：028-65730073/75

传真：028-86725411

(17) 电子交易

本公司电子交易包括网上交易、移动客户端交易等。投资者可以通过本公司网上交易系统或移动客户端办理基金的申购、赎回等业务，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.ChinaAMC.com。

2、场外代销机构

本基金场外代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机

构”中“（一）销售机构”的相关描述。

3、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）。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金在开放日为投资者办理基金申购、赎回等业务。场内申购、赎回业务的开放时间为 9:30~11:30 和 13:00~15:00；场外申购、赎回业务的开放时间由基金管理人与销售机构约定，具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换等业务。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金

份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金已于 2008 年 1 月 14 日上市交易并开放日常赎回业务，2009 年 1 月 14 日起开始办理日常申购业务。

（三）申购与赎回的原则

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

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

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

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

（四）申购与赎回的数额限制

1、投资者办理场内申购时，每笔申购金额不得低于 1,000.00 元（含申购费），投资者通过直销机构办理场外申购时，每笔申购金额不得低于 100.00 元（含申

购费)；投资者通过代销机构办理场外申购时，每笔申购金额不得低于1,000.00元(含申购费，定期定额不受此限制)，单笔不足1,000.00元的申购申请，本基金有权拒绝。具体业务办理请遵循各销售机构的相关规定。

2、投资者赎回份额不设限制。

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

(五) 申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

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

投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认与通知

基金管理人应自身或要求登记结算机构在T+1日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或登记结算机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。但基金管理人、登记结算机构最迟须于受理申购、赎回申请之日起3个工作日内，对申请的有效性进行确认。

3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后，基金管理人应指示基金托管人按规定将基金赎回款从基金资产中划出，经销售机构划往投资者银行账户，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

(六) 申购费与赎回费

1、本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

投资者在申购本基金时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

申购金额(含申购费)

前端申购费率

100 万元以下

1.5%

100 万元以上（含 100 万元）-500 万元以下

1.2%

500 万元以上（含 500 万元）-1000 万元以下

0.8%

1000 万元以上（含 1000 万元）

每笔 1,000.00 元

2、本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。赎回费率为 0.5%。

其中，须依法扣除所收取赎回费总额的 25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定

基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关销售机构同意，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 前端申购费率)

前端申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-前端申购费用

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

对于办理场内申购的投资者，申购份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。对于办理场外申购的投资者，申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

例一：假定T日的基金份额净值为1.200元，若三笔场内申购金额分别为1,000元、100万元、500万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购1

申购2

申购3

申购金额（元，A）

1,000.00

1,000,000.00

5,000,000.00

适用前端申购费率（B）

1.5%

1.2%

0.8%

净申购金额（ $C=A/(1+B)$ ）

985.22

988,142.29

4,960,317.46

前端申购费（ $D=A-C$ ）

14.78

11,857.71

39,682.54

场内申购份额 ($E=C/1.200$)

821

823,451

4,133,597

若场内申购金额为 1000 万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购 4

申购金额（元，A）

10,000,000.00

前端申购费（B）

1,000.00

净申购金额 ($C=A-B$)

9,999,000.00

场内申购份额 ($D=C/1.200$)

8,332,500

例二：假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元，若三笔场外申购金额分别为 1,000 元、100 万元、500 万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购 1

申购 2

申购 3

申购金额（元，A）

1,000.00

1,000,000.00

5,000,000.00

适用前端申购费率（B）

1.5%

1.2%

0.8%

净申购金额（ $C=A/(1+B)$ ）

985.22

988,142.29

4,960,317.46

前端申购费（ $D=A-C$ ）

14.78

11,857.71

39,682.54

场外申购份额（ $E=C/1.200$ ）

821.02

823,451.91

4,133,597.88

若场外申购金额为 1000 万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购 4

申购金额（元，A）

10,000,000.00

前端申购费（B）

1,000.00

净申购金额（C=A-B）

9,999,000.00

场外申购份额（D=C/1.200）

8,332,500.00

2、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例三：假定某投资者在T日赎回10,000份，该日基金份额净值为1.250元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.250=12,500.00元

赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50元

净赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50元

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（八）申购与赎回的登记结算

- 1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。
- 2、投资者T日申购基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记结算手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。
- 3、投资者T日赎回基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者扣除权益

并办理相应的登记结算手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，并最

迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，赎回价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部赎回为止。

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

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

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请。

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资

产净值。

(3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金

业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形。

(5) 因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的。

(6) 个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害。

(7) 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其他基金份额持有人利益的。

(8) 深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购业务的。

(9) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项。

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(3) 基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况。

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。

(5) 深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回业务的。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。

已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

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

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

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

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前两个工作日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十一) 基金转换

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

十一、基金的转托管、非交易过户、冻结与质押等业务

(一) 本基金份额采用分系统登记原则。投资者通过证券经营机构在深圳证券交易所申购或交易买入的基金份额，登记在证券登记系统，以投资者证券账户记载，托管在证券经营机构处；投资者通过基金管理人直销机构及场外代销机构申购的基金份额，登记在基金登记系统，以投资者开放式基金账户记载，托管在基金管理人直销机构或场外代销机构处。

投资者可将登记在深圳证券账户内的基金份额，在深圳证券交易所不同会员单位、或同一会员单位的不同营业部之间办理系统内转托管；也可将登记在开放式基金账户内的基金份额，在基金管理人直销机构或不同场外代销机构之间办理系统内转托管。

投资者还可将基金份额在深圳证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行跨系统转托管。

(二) 登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解

冻、质押等业务，并收取一定的手续费用。

十二、基金的投资

（一）投资目标

把握经济发展趋势和市场运行特征，以行业投资价值评估为导向，充分利用行业周期轮动现象，挖掘在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会，并精选优势行业内的优质个股进行投资，实现基金资产的持续增值。

（二）投资范围

限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%~95%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0~40%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

（三）投资理念

国际经验表明，受经济周期影响，产业发展存在周期轮动现象。一般来说，在经济周期的不同阶段，不同行业受影响的程度往往存在差异，某些特定行业能够在经济周期的特定阶段获得更好地表现，从而形成阶段性的优势行业。因此，借鉴国际产业周期轮动规律，并结合对我国经济周期不同阶段产业发展特征的考察，有助于把握我国经济周期的阶段特征及其对应的优势行业，从而实现对行业景气度和行业成长前景的前瞻性认识和挖掘，充分分享行业景气度提高和业绩成长所带来的价值增值收益。

（四）投资策略

1、资产配置策略

本基金的资产配置采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，综合定性分析和定量分析手段，结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

2、股票投资策略

本基金遵循行业间优化配置和行业个股精选相结合的股票投资策略，其中行业

间优化配置以宏观经济周期分析为基础，重点关注特定经济周期阶段下的优势行业；行业内个股精选着重考察个股的行业发展获益程度，重点关注行业内的优势个股。本基金将对行业和个股投资价值进行持续评估，以准确把握优势行业及优势个股的变化趋势，并据此对组合的行业和个股配置进行及时调整。

（1）行业配置

本基金的行业配置从定性分析和定量分析两个角度进行考察，依据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行重点配置。

①定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。本基金重点关注行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

②定量分析方面，主要依据行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）三项指标进行筛选，上述三项指标的数值均大于 1 的行业将是本基金的投资重点。

（2）个股选择

本基金重点关注优势行业中获益程度最高的优势个股。优势个股的评价标准包括：

①公司主营业务鲜明，行业地位突出，具体的考察指标包括公司的主营业务收入不低于行业平均、主营业务收入占公司总收入的比例高于 50%等。

②公司财务状况良好，盈利能力较强且资产质量较好，具体的考察指标包括成长性指标（过去三年的平均主营业务收入增长率、过去三年的平均息税折旧前利润增长率）不低于行业平均、盈利指标（过去三年的平均净资产收益率、过去三年的平均投资回报率）不低于行业平均。

③公司治理结构规范，管理水平较高，拥有市场自主品牌并具有较强的自主创新和市场拓展能力。

④公司的预期股息回报率高于行业平均和预期动态市盈率低于行业平均。

3、债券投资策略

本基金将采取多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

（1）久期调整策略

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

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。如预测收益率曲线平行移动或变平时，将采取哑铃型策略；预测收益率曲线变陡时，将采取子弹型策略。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资，主要通过信用风险的分析和管理，获取超额收益。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

此外，本基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

（五）投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究

本基金股票投资研究依托公司整体的研究平台，同时整合了外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果。公司研究员按行业分工，负责对各行业以及行业内个股进行跟踪研究。在财务指标分析、实地调研和价值评估的基础上，研究员对所研究的股票、行业提交投资建议报告，供基金经理小组和投资决策委员会参考。此外，公司有专门的宏观经济研究员，负责分析消费、投资、进出口、就业、利率、汇率以及政府政策等因素，为资产配置决策提供支持。公司还设有固定收益部，专门负责债券投资研究。

2、资产配置决策

投资决策委员会负责判断一段时间内证券市场的基本走势，决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理小组在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内，决定基金的具体资产配置。

3、组合构建

基金经理小组根据研究员提交的投资报告，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。对于拟投资的个股，基金经理小组将采取长期关注、择机介入的方法，以降低买入成本、控制投资风险。对于买入的股票，基金的持有周期一般较长，长期持有的操作策略可有效降低基金的交易费用和变现成本，从而提高基金的收益水平。

4、交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

5、风险与绩效评估

风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理小组能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理小组可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整

基金经理小组将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

（六）业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准构成为：

基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

未来，如基金变更投资比例范围，或市场中出现代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，基金管理人可在履行适当程序后，变更本

基金的基准指数或权重构成。

（七）风险收益特征

本基金风险和收益高于货币基金、债券基金，属于高风险、高收益的品种。

（八）投资禁止行为与限制

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）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券。
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%。
- （2）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%。
- （3）基金财产参与股票发行申购时，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。
- （4）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%。
- （5）本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%。
- （6）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。
- （7）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%。
- （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）本基金与本基金管理人管理的其他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%。
- （10）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%。
- （11）法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（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 3 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、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资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 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。

（十）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

（十一）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2016 年第 3 季度报告：

“5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号

项目

金额

占基金总资产的比例（%）

1

权益投资

2,659,655,828.32

81.79

其中：股票

2,659,655,828.32

81.79

2

固定收益投资

50,025,000.00

1.54

其中：债券

50,025,000.00

1.54

资产支持证券

-

-

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

531,819,086.21

16.35

7

其他各项资产

10,309,182.15

0.32

8

合计

3,251,809,096.68

100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码

行业类别

公允价值

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

72,276,362.66

2.24

B

采矿业

30,190,416.41

0.94

C

制造业

1,517,247,660.80

47.09

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

126,284,571.82

3.92

E

建筑业

82,559,145.98

2.56

F

批发和零售业

45,643,801.66

1.42

G

交通运输、仓储和邮政业

2,862,144.40

0.09

H

住宿和餐饮业

5,275,320.00

0.16

I

信息传输、软件和信息技术服务业

167,484,979.73

5.20

J

金融业

208,131,002.46

6.46

K

房地产业

252,454,903.09

7.84

L

租赁和商务服务业

19,011,243.16

0.59

M

科学研究和技术服务业

22,681,060.20

0.70

N

水利、环境和公共设施管理业

78,941,098.45

2.45

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

25,381,737.00

0.79

S

综合

3,230,380.50

0.10

合计

2,659,655,828.32

82.55

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称
数量（股）
公允价值
占基金资产净值比例（%）

1
300156
神雾环保
3,267,258
82,824,990.30
2.57

2
300145
中金环境
2,464,674
65,387,801.22
2.03

3
000671
阳光城
9,852,360
62,168,391.60
1.93

4
600016
民生银行
5,357,300
49,608,598.00
1.54

5

300070

碧水源

2,630,095

48,683,058.45

1.51

6

600856

中天能源

3,869,730

44,927,565.30

1.39

7

600566

济川药业

1,388,017

41,487,828.13

1.29

8

002077

大港股份

2,249,951

41,264,101.34

1.28

9

002043

兔宝宝

3,000,000

40,950,000.00

1.27

10

002384

东山精密

2,199,871

40,741,610.92

1.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号

债券品种

公允价值

占基金资产净值

比例（%）

1

国家债券

-

-

2

央行票据

-

-

3

金融债券

50,025,000.00

1.55

其中：政策性金融债

50,025,000.00

1.55

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）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

50,025,000.00

1.55

5.5 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债券投资明细

金额单位：人民币元

序号

债券代码

债券名称

数量（张）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

1

160401

16农发01

500,000

50,025,000.00

1.55

2

-

-

-

-

-

3

-
-
-
-
-

4

-
-
-
-
-

5

-
-
-
-
-

5.6 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资产支持证券投资
投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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
投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额

1

存出保证金

1,163,174.77

2

应收证券清算款

7,697,504.87

3

应收股利

-

4

应收利息

1,012,415.19

5	应收申购款	435,411.54
6	其他应收款	675.78
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,309,182.15

5.11.4 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。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1

300070

碧水源

48,683,058.45

1.51

重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

十三、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

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

2007年11月22日至2007年12月31日

0.12%

1.38%

5.67%

1.63%

-5.55%

-0.25%

2008年1月1日至2008年12月31日

-44.51%

1.84%

-56.18%

2.44%

11.67%

-0.60%

2009年1月1日至2009年12月31日

78.61%

1.75%

73.60%

1.64%

5.01%

0.11%

2010年1月1日至2010年12月31日

-2.40%

1.32%

-9.12%

1.26%

6.72%

0.06%

2011年1月1日至2011年12月31日

-19.94%

1.12%

-19.67%

1.04%

-0.27%

0.08%

2012年1月1日至2012年12月31日

5.24%

0.98%
7.04%
1.02%
-1.80%
-0.04%

2013年1月1日至2013年12月31日

22.69%
1.18%
-5.30%
1.11%
27.99%
0.07%

2014年1月1日至2014年12月31日

22.83%
1.06%
41.16%
0.97%
-18.33%
0.09%

2015年1月1日至2015年12月31日

52.56%
2.56%
6.98%
1.99%
45.58%
0.57%

2016年1月1日至2016年9月30日

-17.07%
1.88%

-9.45%

1.25%

-7.62%

0.63%

十四、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管及处分

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

十五、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回、转换等提供计价依据。

（二）估值日

基金合同生效后，每个开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日对基金财产进行估值。

（三）估值对象

基金所持有的股票、债券和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

（2）未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，按成本或估值技术确定公允价值。

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值。

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市价估值。

④非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值。

（3）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用成本或估值技术确定公允价值。

（4）发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（5）在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。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人

有充分的理由认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上，基金管理人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。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值方法

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值。

未上市交易的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，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

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

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

（五）估值程序

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

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时。
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时。
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值。
- 4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

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

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

（八）估值错误的处理

- 1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位（含第 3 位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。
- 2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。
- 3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项或权证估值方法的第（2）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易场所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十六、基金的收益与分配

（一）收益的构成

- 1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。
- 2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。
- 3、基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。
- 4、其他收益。

（二）收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权。
- 2、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配。
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。
- 4、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配。
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%，基金合同生效不满三个月，收益可不分配。
- 6、基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按分红权益再投资日的基金份额净值转成相应的基金份额（具体以届时的基金分红公告为准）；如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式。
投资者需注意，登记在深圳证券帐户内的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资。
- 7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

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

（四）收益分配方案的确定与公告

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

（五）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用应由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，登记结算机构可将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值转为基金份额（具体以届时的基金分红公告为准）。

十七、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （1）基金管理人的管理费。
- （2）基金托管人的托管费。

- (3) 基金上市初费及年费。
- (4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）。
- (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) 基金的资金汇划费用。
- (9) 基金收益分配中发生的费用。
- (10) 按照国家有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书更新或相关公告中载明。

2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

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

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

(2) 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

(3) 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。

(4) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(10)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第(一)款第1项约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

(二) 基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十、基金份额的申购、赎回与转换”中的“(六) 申购费与赎回费”与“(七) 申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

(三) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十八、基金的会计与审计

(一) 基金会计政策

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

(二) 基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

十九、基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过

至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（一）基金合同、基金托管协议、基金招募说明书

基金合同、托管协议经中国证监会核准之后，基金管理人应当将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金管理人应当在集中申购期开始 3 日前，将招募说明书登载在指定报刊和网站上。

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

（二）集中申购期基金份额发售公告

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

（三）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在指定报刊及网站上公告。

（四）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3 个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（五）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在集中申购期开始之前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

自集中申购期开始之日起，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（六）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编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

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

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

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

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（七）临时公告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开。
- 2、终止基金合同。
- 3、转换基金运作方式。
- 4、更换基金管理人、基金托管人。
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更。
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更。
- 7、基金管理人的董事长、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。
- 8、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%。
- 9、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%。
- 10、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。
- 11、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查。

- 12、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。
- 13、重大关联交易事项。
- 14、基金收益分配事项。
- 15、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更。
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%。
- 17、基金改聘会计师事务所。
- 18、基金变更、增加、减少基金代销机构。
- 19、基金更换基金登记结算机构。
- 20、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更。
- 21、基金发生巨额赎回并延期支付。
- 22、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请。
- 23、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回。
- 24、基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市。
- 25、基金份额折算与变更登记。
- 26、基金推出新业务或服务。
- 27、基金份额持有人大会的决议。
- 28、中国证监会规定的其他事项。

（八）公开澄清

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

（九）信息披露文件的存放与查阅

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

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

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、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提

供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资者应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金的招募说明书以及相关公告。

本基金在集中申购期内按 1 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

（一）投资于本基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致

市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括：

(1) 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

(2) 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

(3) 债券之发行人出现违约、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。

2、流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

3、积极管理风险

在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

4、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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

5、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二) 声明

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

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

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

二十一、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、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同第十条第（二）款约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。
- 2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。
- 3、但如变更基金合同的事项属于基金合同第十条第（三）款约定的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的。
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的。
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的。
- 4、法律法规规定和经中国证监会认定的其他情形。

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

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算组

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

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

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

3、清算程序

(1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产。

(2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限。

(3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认。

(4) 对基金财产进行评估和变现。

(5) 制作清算报告。

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

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用。

(2) 交纳所欠税款。

(3) 清偿基金债务。

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》：

“九、基金合同当事人及其权利义务

(一) 基金管理人

2、基金管理人的权利

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

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

3、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (3) 办理基金备案手续；

- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(二) 基金托管人

2、基金托管人的权利

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

3、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

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

(17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

(20) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

2、基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、基金合同、业务规则及其他有关规定；

(2) 遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构关于开放式基金业务的相关规则及规定。

(3) 缴纳基金申购款项及基金合同规定的费用；

(4) 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；

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

(6) 执行基金份额持有人大会的决议；

(7) 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、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

十、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1、终止基金合同；

2、转换基金运作方式；

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

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、变更基金类别；

6、变更基金投资目标、范围或策略；

7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

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

9、基金合同、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用；

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

3、经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

4、经中国证监会允许，基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

5、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

6、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

7、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；

8、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四) 召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上（除特别说明，以上含本数，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%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人

有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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

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

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式

式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，如召集人为基金管理人，还应另行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。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，连续公布相关提示性公告；

2、召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

3、召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

4、本人直接出具有效书面意见或授权他人代表出具有效书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

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

6、会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决

意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具有效书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

（2）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

（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。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日，在公证机关及监督人的监督下，由召集人统计全部有效表决并形成决议；如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。决议报经中国证监会核准或备案后生效。

（八）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

特别决议应当经参加大会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。

（2）一般决议

一般决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上多数（不含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效，其他事项均以一般决议的方式通过即为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基

金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人，但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

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监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（十）生效与公告

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

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

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

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

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规规定和经中国证监会认定的其他情形。

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

(三) 基金财产的清算

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

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

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

3、清算程序

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

(8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，

报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十五、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

二十六、基金合同的效力

(五) 本基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所。投资者可登录基金管理人和基金托管人网站查询。”

二十三、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》：

“一、托管协议当事人

(一) 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

成立时间：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）中国证监会核准的其他业务。

存续期间：100 年

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

存续期间：持续经营

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

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

2、对基金投融资比例进行监督。

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

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

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

(1) 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

(2) 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

(3) 如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的固定收益总监批准。

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

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理

人改正。基金管理人发现基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

四、基金管理人基金托管人的业务核查

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

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

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

五、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

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

产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金的银行账户的变更和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的变更和管理。

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

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

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

（三）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

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

（四）基金证券账户和资金账户的变更和管理

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

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

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

（五）债券托管专户的变更和管理

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

（六）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。

（七）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及

有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。

八、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

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

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

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

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

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

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

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

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

（二）基金会计核算

2、会计数据和财务指标的核对

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

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；

半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告，半年度报告或者年度报告。

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

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金

管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

十二、基金份额持有人名册的保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

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

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额

持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

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

十八、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

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

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

二十四、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）电子交易

持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡、中国工商银行借记卡、中国银行借记卡、招商银行储蓄卡、交通银行太平洋借记卡、兴业银行借记卡、民

生银行借记卡、浦发银行东方卡/活期账户一本通、广发银行借记卡、上海银行借记卡、平安银行借记卡、中国邮政储蓄银行借记卡、华夏银行借记卡等银行卡的个人投资者，以及在华夏基金投资理财中心开户的个人投资者，在登录本公司网站（www.ChinaAMC.com）或本公司移动客户端，与本公司达成电子交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可办理基金账户开立、基金申购、赎回、转换、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

机构投资者（不包括已在华夏基金投资理财中心开户的机构投资者）与本公司达成机构网上交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可登录本公司网站（www.ChinaAMC.com），办理基金账户开立、基金申购、赎回、转换、密码修改、信息查询等业务。具体业务办理规则请登录本公司网站查询。

（二）电子邮件及短信服务

投资者在申请开立本公司基金账户时如预留准确的电子邮箱地址、手机号码，将不定期通过邮件、短信形式获得市场资讯、产品信息、公司动态等服务提示；同时，如需订制个性

化服务，可通过本公司网站、邮件、短信、人工等方式操作。

（三）呼叫中心

1、自动语音服务

提供每周7天、每天24小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新热点问题、基金份额净值、基金账户余额等信息。

2、人工电话服务

提供每周7天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为8:30~21:00，周六至周日的人工电话服务时间为8:30~17:00，法定节假日除外。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

（四）在线服务

通过本公司网站，投资者可获得如下服务：

1、查询服务

投资者可登录本公司网站“基金账户查询”，查询基金账户情况、更改个人信息、订制个性化服务。

2、在线客服

投资者可点击本公司网站“在线客服”，进行咨询。周一至周五的在线客服人工服务时间为8:30~21:00，周六至周日的在线客服人工服务时间为8:30~17:

00，法定节假日除外。

3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：www.ChinaAMC.com

电子信箱：service@ChinaAMC.com

（五）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

二十五、其他应披露事项

（一）2016年7月2日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

（二）2016年7月2日发布华夏基金管理有限公司公告。

（三）2016年7月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告。

（四）2016年7月21日发布华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）2016年第2季度报告。

（五）2016年7月28日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构的公告。

（六）2016年8月17日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳富济财富管理有限公司为代销机构的公告。

（七）2016年8月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告。

（八）2016年8月27日发布华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）2016年半年度报告。

（九）2016年8月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构的公告。

（十）2016年9月20日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

（十一）2016年10月25日发布华夏行业精选混合型证券投资基金（LOF）2016年第3季度报告。

(十二) 2016年10月25日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中证金牛(北京)投资咨询有限公司为代销机构的公告。

(十三) 2016年11月1日发布关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在中国中投证券有限责任公司开通申购、赎回等业务的公告。

(十四) 2016年11月2日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增泰诚财富基金销售(大连)有限公司为代销机构的公告。

(十五) 2016年11月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增奕

丰金融服务(深圳)有限公司为代销机构的公告。

(十六) 2016年11月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告。

(十七) 2016年11月18日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

二十六、招募说明书存放及查阅方式

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

二十七、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、兴安证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告。
- 2、中国证监会核准兴安证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件。
- 3、《华夏行业精选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》。
- 4、《华夏行业精选混合型证券投资基金(LOF)托管协议》。
- 5、《证券投资基金登记结算服务协议》。
- 6、法律意见书。
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照。

(二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后,可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年一月五日