

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易 公告书

一、重要声明与提示.	
.....	
..... 1	1
二、基金概览.	
.....	
..... 2	2
三、基金的募集与上市交易.	
.....	
..... 3	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.	
..... 6	6
五、基金主要当事人简介.	
.....	
..... 8	8
六、基金合同内容摘要.	
.....	
..... 11	11
七、基金财务状况.	
.....	
..... 12	12
八、基金投资组合.	
.....	
..... 14	14
九、重大事件揭示.	
.....	
..... 18	18
十、基金管理人承诺.	
.....	
..... 19	19
十一、基金托管人承诺.	

.....
..... 20

十二、备查文件目录.

.....
..... 21

附件：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要.

..... 22 1

一、重要声明与提示

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）之上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、

《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2016 年 10 月 20 日《证券时报》以及浙江浙商证券资产管理有限公司网站（www.stocke.com.cn）上

的《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。

2

二、基金概览

1、基金名称：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金

2、基金类别：混合型

3、基金运作方式：契约型。基金合同生效后，本基金设一个 18 个月的封闭期，本基金封闭期自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）至 18 个月（含第 18 个月）后对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）止，如

该

日不存在对应日期的，则延后至下一日。

本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。

4、本基金的存续期限：不定期。

5、基金份额总额：截至 2017 年 3 月 9 日，基金份额总额为 227,360,147.48 份

6、基金份额净值：1.0092（截至 2017 年 3 月 9 日）

7、本基金场内简称：浙商鼎盈，基金代码 169201

8、本次上市交易的基金份额总额：46,510,123.00 份（截至 2017 年 3 月 9 日）

9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

10、上市交易日期：2017 年 3 月 16 日

11、基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

12、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

13、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司 3

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1634 号

2、基金运作方式：契约型。

基金合同生效后，本基金设一个 18 个月的封闭期，本基金封闭期自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）至 18 个月（含第 18 个月）后对

应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）止，如该日不存在对应日期的，则延后至下一日。

本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2016年10月25日至2016年11月29日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构

(1) 场内发售机构

场内代销机构是指具有基金销售业务资格、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、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳交易所会员单位，包括爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源、西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、

4

江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、

西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券

(2) 场外发售机构

1) 直销机构：浙江浙商证券资产管理有限公司

2) 代销机构：浙商证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、兴业银行股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、大泰金石投资管理有限公司、东吴证券股份有限公司

8、验资机构名称：北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为人民币 227,290,299.59 元，确认有效认购份额（不含利息转份额）为 227,290,299.59 份，

利息结转份额 69,848.64 份，总确认份额为 227,360,148.23 份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于 2016 年 12 月 2 日全额划入本基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算本基金募集期间含本息共募集 227,360,148.23 份基金份额，其中场外认购的基金份额

额为 184,834,628.23 份；场内认购的基金份额为 42,525,520.00 份。

10、基金备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2016 年 12 月 7 日获中国证监会

书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2016 年 12 月 7 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：227,360,148.23 份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、本基金的上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2017】161 号

2、上市交易日期：2017 年 3 月 16 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：浙商汇金鼎盈定增混合

场内简称：浙商鼎盈

5、交易代码：169201

6、本次上市交易份额：46,510,123.00 份（截至 2017 年 3 月 9 日）

7、基金资产净值的披露：每个交易日的次日公布本基金的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易份额托管在场外，基金份额持有人可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统后，即可上市交易。

6

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）持有人户数

截至 2017 年 3 月 9 日，本基金份额持有人户数为 2,657 户，其中场内基金份额持有人户数为 747 户，平均每户持有的场内基金份额 62,262.55 份；场外基金份额持有人户数 1,910 户，平均每户持有场外基金份额为 94,685.88 份。

（二）持有人结构

截至 2017 年 3 月 9 日，本基金场内外所有基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金基金份额 28,978,541.81 份，占基金份额总额比例为 12.75%；个人投资者持有的本基金基金份额 198,381,605.67 份，占基金份额总额比例为 87.25%。

其中，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的场内本基金基金份额 5,979,859.00 份，占基金份额总额比例为 2.63%；场内个人投资者持有的场内本基金基金份额 40,530,264.00 份，占基金份额总额比例为 17.83%。

场外基金份额持有人结构如下：

场外机构投资者持有的场外本基金基金份额 22,998,682.81 份，占基金份额总额比例为 10.11%；场外个人投资者持有的场外本基金基金份额 157,851,341.67 份，占基金份额总额比例为 69.43%。

（三）基金份额前十名持有人情况

截至 2017 年 3 月 9 日，场内前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
----	-----------	--------	---------------

1

招商基金-投资型航空
综合保险（一年期）资
产管理计划

3,984,603.00 8.57

2 董昌旺 3,000,058.00 6.45

3 廖龙 2,000,077.00 4.30

7

4

上海瑜庭投资管理有
限公司—瑜庭一号私
募证券投资基金

1,500,247.00 3.23

5 杜阳学 1,500,160.00 3.23

6 朱洲 1,005,039.00 2.16

7 武装 1,000,038.00 2.15

8 倪建良 991,134.00 2.13

9 陈蓉 750,065.00 1.61

10 张胜楠 650,025.00 1.40

合计 16,381,446.00 35.23

（四）基金管理人的从业人员持有本基金的情况：

截至 2017 年 3 月 9 日，基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下表。

项目 持有份额总数（份） 占基金总份额比例

基金管理人所有从业人

员持有本基金

3,288,649.68 1.4464%

（五）基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，以及本
基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间情况：

截至 2017 年 3 月 9 日，基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门
负责人，以及本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间情况如下表。

项目 持有本基金份额总量的数量区间（万份）

基金管理人高级管理人员、基金

投资和研究部门负责人持有本基

金

0-10（含）

本基金基金经理持有本基金 0

8

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区天水巷 25 号

办公地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 C 座 1106 室

法定代表人：李雪峰

设立日期：2013 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2012]1431 号

联系电话：（0571）87901590

联系人：金瓚

2、注册资本和股权结构

（1）注册资本：5 亿元人民币

（2）股权结构

股东名称 持股占总股本比例

浙商证券股份有限公司 100%

3、简要情况介绍：

公司建立了权责分明、分工明确的内部控制组织体系，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：基金管理人设董事会，对股东负责。董事会有 5 名董事组成，设董事长 1 人。基金管理人已制定《董事会议事规则》，规定了董事会会议的召开及表决程序和职责等。

基金管理人设监事一名。公司监事依照法律及章程的规定负责检查财务和合规管理；对董事、总经理及其他高级管理人员执行职务时违反法律、法规或者章程的行为进行监督；督促落实风险管理体系的建立和实施及相关事项的整改；并就涉及基金管理人风险的重大事项向股东汇报。

经营管理层负责组织实施董事会决议，主持基金管理人的经营管理工作，负责经营管理中风险管理工作的日常运行。负责董事会授权范围内重大经营

9

项目和创新业务的风险评估和决策。经营管理层下设投资决策委员会、产品委员会、风险控制委员会，并分别制定了相应的议事规则，对各项重大业务及投资进行决策与风险控制。

4、人员情况

截至 2016 年底，公司员工总数 130 人，其中 58%以上具有硕士及以上

学历。

5、信息披露负责人及咨询电话

高玮 (0571) 87901590

6、本基金基金经理

赵语涛，上海交通大学工学博士，8 年证券从业经验。历任东海证券、海通证券资产管理部、兴业基金研究员，浙商资管公募基金部基金经理助理，自 2016 年 3 月 10 日起任浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的基金经理，

自 2016 年 2 月 29 日起任浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立日期：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

法定代表人：易会满

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】3 号

联系人：洪渊

联系电话：010-66105798

2、主要人员情况

截至 2016 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究

10

生以上学历或高级技术职称。

3、证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业

客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2014 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 407 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 45 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）基金验资机构

名称：北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区裕民路 18 号北环中心 22 层

办公地址：北京市西城区裕民路 18 号北环中心 22 层

执行事务合伙人：陈胜华

电话：（010）82250666

联系人：张庆栾

经办会计师：张庆栾、李鑫

11

六、基金合同内容摘要

基金合同内容摘要请见附件

12

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金自基金合同生效至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 3 月 9 日资产负债表（未经审计）如下：

资产 期末余额 负债与持有人权益 期末余额

资产： 负债：

银行存款 19,027,812.57 短期借款 0

结算备付金 5,499,037.26 交易性金融负债 0

存出保证金 52,695.60 衍生金融负债 0

交易性金融资产 131,241,051.51 卖出回购金融资产款 0

其中：股票投资 131,241,051.51 应付证券清算款 3,452,583.21

债券投资 0 应付赎回款 0

基金投资 0 应付管理人报酬 85,323.50

权证投资 0 应付托管费 14,220.59

资产支持证券投资 0 应付销售服务费 0

衍生金融工具 0 应付交易费用 199,937.62

买入返售金融资产 75,000,000.00 应交税费 0

应收证券清算款 2,451,216.71 应付利息 0

应收利息 51,118.87 应付利润 0

应收股利 0 其他负债 129,808.48

应收申购款 0 负债合计 3,881,873.40

其他资产 0

所有者权益：

13

实收基金 227,360,147.48

未分配利润 2,080,911.64

所有者权益合计 229,441,059.12

资产合计 233,322,932.52 负债和所有者权益总计 233,322,932.52

注：报告截止日 2017 年 3 月 9 日，本基金份额净值：1.0092 元，本基金份额总额：227,360,147.48 份。

14

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2017 年 3 月 9 日，本基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

序号 项目 金额

占基金总资产

的比例（%）

- 1 权益投资 131,241,051.51 56.25
- 其中：股票 131,241,051.51 56.25
- 2 固定收益投资
- 其中：债券
- 资产支持证券
- 3 金融衍生品投资
- 4 买入返售金融资产 75,000,000.00 32.14

其中：买断式回购的买入返售
金融资产

- 5 银行存款和结算备付金合计 24,526,849.83 10.51
- 6 其他资产 2,555,031.18 1.1
- 7 合计 233,322,932.52 100

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比

- A 农、林、牧、渔业
- B 采矿业 3,819,630.36 1.66%
- C 制造业 88,920,361.43 38.76%
- D 电力、热力、燃气及水生产和供
应业
4,358,986.28 1.90%
- E 建筑业
- F 批发和零售业 3,548,735.58 1.55%
- G 交通运输、仓储和邮政业
- H 住宿和餐饮业 4,769,046.00 2.08%
- 15
- I 信息传输、软件和信息技术服务
业
4,677,388.40 2.04%
- J 金融业 4,173,945.00 1.82%
- K 房地产业
- L 租赁和商务服务业

M 科学研究和技术服务业
 N 水利、环境和公共设施管理业 6,490,400.00 2.83%
 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 5,086,400.00 2.22%
 S 综合 5,396,158.46 2.35%
 合计 131,241,051.51 57.20%

(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序 号	证券代 码	证券名称	数量	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002171	楚江新材	1,196,014.00	18,263,133.78	7.96%
2	000826	启迪桑德	190,000.00	6,490,400.00	2.83%
3	002241	歌尔股份	200,000.00	6,284,000.00	2.74%
4	600172	黄河旋风	320,000.00	5,996,800.00	2.61%
5	600498	烽火通信	221,700.00	5,824,059.00	2.54%
6	600699	均胜电子	179,814.00	5,653,352.16	2.46%
7	600783	鲁信创投	219,982.00	5,396,158.46	2.35%
8	600885	宏发股份	150,000.00	5,157,000.00	2.25%
9	600977	中国电影	220,000.00	5,086,400.00	2.22%
10	600258	首旅酒店	179,964.00	4,769,046.00	2.08%
合计			3,077,474.00	68,920,349.40	30.04%

16

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值 的比例 (%)
----	------	----------	--------------------

1 国家债券 --

- 2 央行票据 --
- 3 金融债券 --
- 其中：政策性金融债 --
- 4 企业债券 --
- 5 企业短期融资券 --
- 6 中期票据 --
- 7 可转债
- 8 其他 --
- 9 合计

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资
明细

截止 2017 年 3 月 9 日，本基金未持有债券。

(六) 按市值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
截止 2017 年 3 月 9 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资
明细

截止 2017 年 3 月 9 日，本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

截止 2017 年 3 月 9 日，本基金未持有股指期货。

(九) 投资组合报告附注

1、报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

2、 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股
票。

17

3、报告期末，其他各项资产构成

序号 名称 金额

- 1 交易保证金 52,695.60
- 2 应收证券清算款 2,451,216.71
- 3 应收股利
- 4 应收利息 51,118.87
- 5 应收申购款

6 其他应收款

7 待摊费用

8 其他

9 合计 2,555,031.18

4、报告期末，持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2017 年 3 月 9 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末，前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称

流通受限部分

的公允价值

占基金资产

净值比例

(%)

流通受限情况说

明

1 002171 楚江新材 18,263,133.78 7.96% 非公开发行认购

6、报告期末，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。

18

九、重大事件揭示

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同已于 2016 年 12

月 7 日正式生效，基金管理人已于 2016 年 12 月 8 日在《证券时报》及基金
管理

人网站 (www.stocke.com.cn) 刊登《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资
资

基金基金合同生效公告》。

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影
响的重大事件。

19

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、

勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

20

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。

（三）如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

21

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会关于准予浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件

（二）《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

（四）《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件。

浙江浙商证券资产管理有限公司

2017年3月13日

22

附件：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利和义务

（一）基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有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》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其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

23

有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，

并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利

益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

24

实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

(5) 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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，

确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、
25

《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保密，不
向他人泄露；

(13) 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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相
关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且
保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的
公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会
并通知基金托管人；

(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合法
权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基
金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有
人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基
金事务的行为承担责任；

(23) 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；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能
生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利
息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- (2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户和期货账户等投资所需其他账户，为基金办理证券/期货交易资金清算；
- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，

保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

27

- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需其他账户，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；

(7) 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予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人

28

利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代

表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式，但本基金自基金合同生效后第 18 个月度对日起，满足基金合同约定的存续条件，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF）除外；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略，但基金合同另有规定的除外；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (14) 法律法规、《基金合同》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。

29

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(5) 在对既有基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定的范围内，在对既有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、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，应当由基金托管人自行召集，并自基金托管人出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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

30
持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，

基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）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；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人

31

到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。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、受托出席会议者出具的委托人

持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）。参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，

32

则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）；参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

(4) 上述第(3)项中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、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符;

3、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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

(1) 现场开会

33

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决

截止日期后 5 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公

证
机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表
决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决
议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持
表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管
理

人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有
效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交
符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面
符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾

34

的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额
总数。

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。

（七）计票

1、现场开会

（1）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选举两名基
金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基
金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管
理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始
后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票
人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当

场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

35

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金收益分配原则

1、在封闭期内，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数不得少于 1 次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的 90%，

若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。转换为上市开放式基金

(LOF)

后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，

每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。本基金封闭期内的收益分配方式为现金分红。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，基金份额持有人选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

36

5、投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

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

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本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，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

四、与基金财产管理、运用有关费用的计提、支付方式与比例

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他

37

费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中

一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产

中

一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额或预提金额来列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

（一）投资目标

在封闭期内，本基金主要投资于定向增发的证券，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过对定向增发证券投资价值的深入分析，力争基金资产的长期稳定增值。转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下

38

的事件性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，开放期内每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%—100%，投资于权证的比例不超过基金资产的 3%。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭期内，本基金股票投资比例为基金资产的 0%-100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于 80%；转成上市开放式基金（LOF）后，本基金股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；

（2）转成上市开放式基金（LOF）后的每个交易日日终，在扣除股指期货

39

和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（3）本基金持有一家上市公司的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

（12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，

本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购期限到期后不得展期；

(15) 封闭期内，本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；
转成上市开放式基金（LOF）后，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 本基金参与股指期货和国债期货交易依据下列标准建构组合：

(16.1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

(16.2) 在封闭期内的每个交易日日终，持有的买入国债期货合约价值、股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；转成上市开放式基金（LOF）后，本基金每个交易日日终，持有的买入国债期货合约价值、股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；
其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

(16.3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(16.4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(16.5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进

行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

基金管理人应当自本基金转为上市开放式基金（LOF）之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人只须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）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；
- （7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

3、关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）基金资产净值、基金份额净值的公告方式

1、封闭期内

《基金合同》生效后，基金上市交易前，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。

基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易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款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

2、转化为上市开放式基金（LOF）后

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发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款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

七、基金合同变更和终止事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

43

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

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、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、新基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
- 2、基金财产清算小组成员：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
- 3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
- 4、基金财产清算程序：
 - （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
 - （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
 - （3）对基金财产进行估值和变现；
 - （4）制作清算报告；
 - （5）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；
 - （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。
 - （7）对基金财产进行分配；
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

44

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进

行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，或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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。