

**金元顺安成长动力灵活配置  
混合型证券投资基金更新招募说明书  
(2017年2号)**

**基金管理人：金元顺安基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

**二〇一七年十月**

## 重要提示

金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金（原名：金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）根据2008年6月16日中国证券监督管理委员会下发的《关于同意金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2008]810号）的核准，进行募集。本基金基金合同于2008年9月3日生效。基金管理人于2012年3月15日更名为金元惠理基金管理有限公司，本基金基金名称相应变更为“金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人于2015年3月6日更名为金元顺安基金管理有限公司，本基金基金名称相应变更为“金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金”。上述变更事项已报中国证监会备案。

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。

投资有风险，基金投资者认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。作为灵活配置混合型基金，本基金将力争通过对股票、债券等大类资产的有效合理配置规避系统风险、降低投资组合的波动性，但同时也可能存在因本基金如下原因而产生的风险：一、投资管理人对市场判断有误从而导致资产配置比例不合适而产生的风险；二、本基金使用“股票盈利增长分析指标评价体系”和“ROIC模型”进行选股，使用的指标、分值、计算方法的选取不当会影响组合中股票构成与投资业绩；三、股票研究不深入与业绩预测不准确带来的风险。在本基金的选股方法中，使用了预测性的指标，包括当年的净利润增长率、预期中长期净利润增长率、预期中长期每股收益增长率、预期市盈率等，如果研究不深入、业绩预测不准确会增加投资风险。投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险。

本《招募说明书》依据本基金《基金合同》编写，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得

基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 9 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日。

## 目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集.....	39
七、基金合同的生效.....	40
八、基金份额的申购与赎回.....	41
九、基金的投资.....	49
十、基金的财产.....	68
十一、基金资产的估值.....	69
十二、基金的费用与税收.....	75
十三、基金的收益分配.....	77
十四、基金的会计与审计.....	79
十五、基金的信息披露.....	80
十六、风险揭示.....	85
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	88
十八、基金合同内容摘要.....	91
十九、基金托管协议的内容摘要.....	127
二十、对基金份额持有人的服务.....	144
二十一、其它应披露事项说明.....	146
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	147
二十三、备查文件.....	148

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》、《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称基金合同)及其它有关的规定编写。

本招募说明书阐述了金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率等与基金投资者投资决策有关的必要事项,基金投资者在做投资决策前应仔细阅读本招募说明书,并根据自身风险承受能力谨慎选择基金产品。

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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指金元顺安基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订的《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日
- 7、基金份额发售公告：指《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订。
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，并自2013年6月1日起实施并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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
- 10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《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
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布，同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、中国：指中华人民共和国，就本招募说明书而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会或其他地方派出机构

15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

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

20、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的基金投资者

22、基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指直销机构和代销机构

24、直销机构：指金元顺安基金管理有限公司

25、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

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

28、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司或接受金元顺安基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

29、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

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

31、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

32、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

33、基金募集期限：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、日：指公历日

37、月：指公历月

38、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

39、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

40、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、业务规则：指《金元顺安基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记运作等方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守

43、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

44、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

45、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

46、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

47、转托管：指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务

48、巨额赎回：本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时

49、元：指人民币元

50、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款



利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

54、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

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

56、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：金元顺安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

成立日期：2006年11月13日

法定代表人：任开宇

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[2006]222号

经营范围：募集基金、管理基金和经中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2.45亿元

存续期间：持续经营

联系人：孙筱君

联系电话：021-68882850

股权结构：金元证券股份有限公司占公司总股本的51%，上海泉意金融信息服务有限公司占公司总股本的49%。

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

董事会为公司的执行机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由8名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由4名监事组成，其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置基金投资部、专户投资部、研究部、固定收益及量化部、产品开发部、市场营销部、机构理财部、北京办事处、华东营销中心、华南营销中心、信息技术部、基金事务部、交易部、财务部、人事行政部、监察稽核部、资产管理部、金融同业部、创新投资部、金融市场部、资本市场部和投资部等 22 个职能部门。此外，公司董事会下设风险控制与合规审核委员会、资格审查委员会和薪酬管理委员会，公司总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会。

## (二) 主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

任开宇先生，董事长，博士学位。曾任长春证券有限公司总裁助理，新华证券有限公司监事长，金元证券有限公司投行总监。2008 年至今，任金元证券股份有限公司副总裁；2010 年 7 月出任金元顺安基金管理有限公司董事，2010 年 9 月出任金元顺安基金管理有限公司董事长。

史克新先生，董事，学士学位。曾任珠海会计师事务所注册会计师、君安证券有限公司审计师、北大方正投资有限公司副总经理、兴安证券东莞营业部总经理和深圳丽晶生物技术有限公司董事长。2007 年至今，任金元证券股份有限公司经纪服务总部总经理、副监事长。

冷天晴先生，董事，学士学位，冷天晴先生长期在军区部队服役，主要从事军队内部的管理工作，后相继于多家大型企业担任总经理、执行董事等高级职务，曾于 2012 年 9 月至 2013 年 5 月任云南工投集团动力配煤股份有限公司总经理，现担任云南九天投资控股集团有限公司总经理，主持公司的全面工作，此外兼任云南滇中供应链管理集团有限公司执行董事、深圳滇中商业保理有限公司执行董事。

栗旻先生，董事，硕士学位。栗旻先生长期在中国农业银行多个岗位担任管理职位，自 1996 年始至 2012 年在农业银行先后担任了分行营业部公司业务部/国际业务部担任副总经理、总经理，在农行云南省分行下属的支行担任副行长、行长等职务。自 2012 年始担任深圳滇中商业保理有限公司总经理至今。

李宪英先生，独立董事，硕士学位。曾任大庆市第一医院医师、大庆市中胜律师事务所律师，现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人。

张屹山先生，独立董事。曾任吉林大学数学系助教，吉林大学经济管理学院任副教授，日本关西学院大学客座教授，天治基金管理有限公司独立董事；1992 年 5 月，出任吉林大学商学院院长、博士生导师。

潘书鸿先生，独立董事，学士学位。潘书鸿先生曾于 1995 年至 1999 年任上海功茂

律师事务所行政主管，于1999年至2006年任上海崇林律师事务所（后更名为上海海之纯律师事务所）行政主管，此后自2006年至今在上海恒建律师事务所担任主任律师、首席合伙人。另外，潘书鸿先生自2013年至今在第十届上海律师协会担任副会长，自2016年至今在上海仲裁委员会担任仲裁员。

张嘉宾先生，董事，公司总经理，兼任子公司董事长，工商管理硕士。曾任深业美国公司（新泽西）副总裁，瑞银华宝（纽约）业务经理，富国基金管理有限公司总经理助理、市场总监，信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官，中国光大资产管理有限公司（香港）首席运营官，民生加银基金管理有限公司总经理。

## 2、基金管理人监事会成员

郭长洲先生，监事会主席，本科学位，金元证券股份有限公司财务总监、财务部总经理。曾任山东济南乾聚会计师事务所经理、BDO利安达会计师事务所业务经理、航港金控投资有限公司业务经理，历任首都机场集团公司业务经理、首都机场财务有限公司总经理助理、首都机场地产集团有限公司财务部总经理、财务总监。

李春光先生，监事，硕士学位，具有上海证交所颁发的董秘资格证书。李春光先生于2005年至2015年在云南凌云律师事务所担任律师，自2015年至今在上海泉意金融信息服务有限公司担任副总经理。

陈渝鹏先生，员工监事，兼任子公司监事，硕士学位，金元顺安基金管理有限公司信息技术部总监。曾任银通证券信息部主管，金元证券电脑总部助理主管工程师。

洪婷女士，员工监事，本科学历，金元顺安基金管理有限公司财务副总监。曾任职于昆山组合服饰有限公司出纳及华尔街英语金茂培训中心财务会计。

## 3、管理层人员情况

任开宇先生，董事长，简历同上。

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

凌有法先生，督察长，硕士学位。曾任华宝信托有限公司发展研究中心研究员、债券业务部高级经理，联合证券有限公司固定收益部业务董事，金元证券有限公司资产管理部首席研究员，首都机场集团公司资本运营部专家。

符刃先生，副总经理，硕士学位。曾任海南国信资产管理公司总经理助理，香港海信投资有限公司总经理，历任金元证券有限公司基金筹备组负责人，公司督察长。

邝晓星先生，财务总监，学士学位。曾任海南省国际信托投资公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司财务总部经理助理，历任金元证券有限责任公司基金筹备组成员。

李锐先生，副总经理，硕士学位。曾任国金证券股份有限公司金融理财部总经理，中国民生银行石家庄分行历任金融市场部总经理助理（主持全面工作）、金融市场部副总经理（主持全面工作）。

陈嘉楠女士，副总经理，硕士学位。曾任上海金元百利资产管理有限公司创新金融部副总经理，西南证券股份有限公司投行部董事，新兴集团总经理助理，联想集团有限公司高级经理。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理：

闵杭先生，总经理助理，投资总监，金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理，上海交通大学工学学士。曾任湘财证券股份有限公司上海自营分公司总经理，申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司。23年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

孔祥鹏先生，金元顺安新经济主题混合型证券投资基金和金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，北京大学理学硕士。曾任上海市盟洋投资管理有限公司投资部研究员，中山证券有限责任公司研究所研究员，德邦证券有限责任公司研究所研究员。2015年5月加入金元顺安基金管理有限公司。5年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

##### （2）历任基金经理：

- 1) 何旻先生：2008年9月至2009年3月。
- 2) 万文俊先生：2008年9月至2010年3月。
- 3) 吴广利先生：2009年6月至2011年9月。
- 4) 冯志刚先生：2012年2月至2013年4月。
- 5) 晏斌先生：2013年1月至2015年11月。
- 6) 侯斌女士：2010年12月至2017年6月。

#### 5、投资决策委员会成员的姓名和职务

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

闵杭先生，投资总监，基金经理，简历同上。

孔祥鹏先生，基金经理，简历同上。

侯斌女士，金元顺安核心动力混合型证券投资基金的基金经理，上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入金元顺安基金管理有限公司，历任高级行业研究员，金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金经理助理，金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元顺安宝石动力混合型证券投资基金的基金经理。15年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

李杰先生，金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金的基金经理，上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入金元顺安基金管理有限公司。10年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

缪玮彬先生，金元顺安价值增长混合型证券投资基金和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016年10月加入金元顺安基金管理有限公司。19年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

郭建新先生，金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理，西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016年9月加入金元顺安基金管理有限公司。7年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经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募集、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 15 年以上；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》及其他法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司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）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反法律法规、基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）违反证券交易所业务规则，扰乱市场秩序；
- （9）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(10) 其他法律、法规及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行。

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

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

##### 2、内部控制的主要内容

###### (1) 控制环境

公司建立健全的法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司管理层树立内控优先的风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，建立风险控制优先、风险控制人人有责、一线人员第一责任的公司内控文化，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，确保公司各项决策、决议的执行中，“四眼”原则贯穿全程。各部门及岗位有明确的授权分工、工作职责和业务流程，通过重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。



公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制。通过法律法规培训、制度教育、执业操守教育和行为准则教育等，确保公司人员了解与从业有关的法规与监管部门规定，熟知公司相关规章制度、岗位职责与操作流程，具备与岗位要求相适应的操守和专业胜任能力。

## (2) 风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司的业务风险、人员风险、法律风险和财务风险等进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。通过科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实现定量分析和管理。通过收集与投资组合相关的会计和市场数据，建立一个投资风险测评与绩效评估的信息技术平台。由监察稽核部定期向投资决策委员会和风险管理委员会提交风险测评报告。

## (3) 内控机制

公司全部的经营管理决策，均按照明确成文的决策程序与规定进行，防止超越或违反决策程序的随意决策行为的发生。

操作层面上，公司依据自身经营特点，以各岗位目标责任制为基础形成第一道内控防线，以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡形成第二道内控防线，以监察稽核部、风险管理委员会、督察长对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈形成第三道内控防线，并建立内部违规违章行为的处罚机制。同时，按照分级管理、规范操作、有限授权、业务跟踪的原则，制定公司授权管理制度，并严格区分业务授权与管理授权。

## (4) 信息与沟通

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

## (5) 监督与内部稽核

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

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确。
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准 (ISAE3402) 认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行

着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2016年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2017年6月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共372只。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业

务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、联系电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，联系电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 直销机构

金元顺安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

法定代表人：任开宇

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608

联系电话：021-68882850

传真：021-68882865

联系人：孙筱君

客户服务专线：400-666-0666

网址：[www.jysa99.com](http://www.jysa99.com)

### (二) 代销机构

#### 1、中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：张伟

联系电话：010-85109230

传真：010-85109219

客服电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

#### 2、中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

联系人：杨菲

联系电话：010-66107909

传真：010-66107914

客服电话：95588

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

### 3、中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

联系人：张静

联系电话：010-67596219

传真：010-66275654

客服电话：95533

公司网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### 4、交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张作伟

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 5、招商银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：于菲

联系电话：0755-83161095

传真：0755-83195050

客服电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

6、中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

联系人：文彦娜

联系电话：010-68858101

传真：010-68858117

客服电话：95580

公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

7、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：董金

联系电话：010-85238441

传真：010-85238680

公司网站：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

8、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊

联系电话：021-61614467

传真：021-63604199

客服电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

9、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号



法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-57092619

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

10、中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

联系人：王媛

联系电话：010-89937322

传真：010-65550827

客服电话：95558

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

11、上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：金煜

联系人：王笑

联系电话：021-68475732

传真：021-68476111

客服电话：95594

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

12、平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

联系电话: 021-38637673

传真: 021-50979507

客服电话: 95511-3

公司网址: [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

#### 13、金元证券股份有限公司

注册地址: 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址: 深圳市深南大道 4001 时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人: 陆涛

联系人: 马贤清

联系电话: 0755-83025022

传真: 0755-83025625

客服电话: 4008-888-228

公司网址: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

#### 14、中国民族证券有限责任公司

注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人: 何亚刚

联系人: 李微

联系电话: 010-59355941

传真: 010-66553791

客服电话: 400-889-5618

公司网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

#### 15、中信建投证券有限责任公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

联系人: 许梦园

联系电话: 010-85156398

客服电话: 400-8888-108

传真：010-65182261

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

16、光大证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：李晓哲

联系电话：021-22169111

传真：021-22169134

客服电话：95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

17、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：021-54033888

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

18、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

19、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系电话：021-38565785

联系人：柯延超

联系电话：0591-38507950

客服电话：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

20、招商证券股份有限公司

注册地址：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 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

联系人：黄蝉君

客户服务电话：95565、4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

21、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38676767

传真：021-38670666

服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

22、华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82493561

传真：025-51863323

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

#### 23、中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

#### 24、广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河北路大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-333

传真：020-87553600

公司网址：www.gf.com.cn

#### 25、国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座

法定代表人：蔡咏

联系人：陈琳琳

联系电话：0551-2246273

传真：0551-62272100

客服电话：95578

公司网站：www.gyzq.com.cn

26、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

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：张佑君

联系人：侯艳红

联系电话：010-60838995

传真：010-60833739

客服电话：95548

公司网站：www.cs.ecitic.com

27、华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号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

联系人：郭相兴

联系电话：021-20655175

传真：0591-87383610

客服电话：0591-96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

28、信达证券股份有限公司

注册（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：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

传真：010-63080978

客服电话: 95321

公司网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

#### 29、长江证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址: 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人: 尤习贵

联系人: 奚博宇

联系电话: 021-68751860

客户服务电话: 95579、4008-888-999

公司网站: [www.95579.com](http://www.95579.com)

#### 30、中信证券(山东)有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址: 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人: 杨宝林

联系人: 孙秋月

联系电话: 0532-85022026

传真: 0532-85022605

客服电话: 95548

公司网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

#### 31、天相投资顾问有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人: 林义相

联系电话: 010-66045152

传真: 010-66045500

联系人: 尹伶

客服电话: 010-66045678

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

#### 32、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

联系电话：021-20211847

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

33、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

联系电话：021-38509680

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

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

34、杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：郭轶凡

联系电话：021-61686888

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

35、深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道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



法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

36、和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835787

传真：010-85650806

客服电话：400-920-0022

公司网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

37、上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：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

联系人：何昶

联系电话：021-20691922

传真：021-58787698

客服电话：400-820-2899

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

38、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：徐汇区龙田路195号3C座9层

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话: 021-54509988

客服电话: 400-1818-188

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

39、上海利得基金销售有限公司

注册地址: 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: 李兴春

联系人: 曹怡晨

联系电话: 021-60195148

客服电话: 400-921-7755

公司网址: [www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)、[a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn)

40、北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址: 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

联系人: 陈剑炜

联系电话: 010-57418813

客服电话: 400-893-6885

公司网址: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

41、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 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: 周斌

联系人: 祖杰

联系电话: 010-57756159

客服电话: 4008-980-618

公司网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

42、海银基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号陆家嘴金融服务广场 16F

法定代表人：刘惠

联系人：何春燕

联系电话：021-80133828

客服电话：400-808-1016

公司网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

#### 43、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：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：张彦

联系人：张燕

联系电话：010-58325388

客服电话：400-166-1188

公司网址：[www.jrj.com.cn](http://www.jrj.com.cn)

#### 44、兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：曾鸣

联系电话：021-52629999-218906

客服电话：95561

公司网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

#### 45、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系人：刘晓倩

联系电话：0571-88911818-8653

客服电话：4008-773-772

公司网址: fund.10jqka.com.cn

46、上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人: 金佶

联系人: 陈云卉

联系电话: 021-33323999-5611

客服电话: 400-820-2819

公司网址: www.chinapnr.com

47、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 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: 鲍东华

联系人: 宁博宇

联系电话: 021-20665952

客服电话: 4008666618

公司网址: www.lu.com

48、申万宏源西部证券有限公司

注册地址: 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: 北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人: 韩志谦

联系人: 唐岚

联系电话: 010-88085258

传真: 010-88085195

客服电话: 4008-000-562

公司网址: www.hysec.com

49、中国国际金融股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街国贸写字楼2座28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166-6493

客服电话：400-910-1166

公司网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

#### 50、大泰金石基金销售有限公司

注册地址：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

联系人：赵明

联系电话：021-20324155

客服电话：400-928-2266

公司网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

#### 51、上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

联系电话：021-52822063-8102

客服电话：021-52822063

公司网址：[www.91fund.com.cn](http://www.91fund.com.cn)

#### 52、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21层

法定代表人：蒋煜

联系人：徐晓荣

联系电话：010-58170876

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

公司网址：www.shengshiview.com

53、中信期货有限公司

注册地址：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室、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室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

联系电话：010-60833754

传真：010-57762999

客服电话：400-9908-826

公司网址：www.citicsf.com

54、宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：中国浙江宁波市宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

联系人：于波涛

电话：0574-87050038

客户服务电话：96528

联系电话：086-574-87050028

公司网址：www.nbcb.com.cn

55、方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：高利

联系人：高洋

电话：010-59355546

传真：010-56437013

客户服务电话：95571

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

56、北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

法定代表人: 王伟刚

联系人: 丁向坤

电话: 010-56282140

传真: 010-62680827

客户服务电话: 400-619-9059

公司网址: [www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

57、天津国美基金销售有限公司

注册地址: 天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801

法定代表人: 丁东华

联系人: 许艳

电话: 010-59287105

传真: 010-59287825

客户服务电话: 400-111-0889

公司网址: [www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

58、泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人: 林卓

联系人: 姜焕洋

电话: 0411-88891212

传真: 0411-84396536

客户服务电话: 400-6411-999

公司网址: [www.haojiyoujijin.com](http://www.haojiyoujijin.com)

59、上海万得投资顾问有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人: 王廷富

联系人：孙骏

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客户服务电话：400-821-0203

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

60、深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：15813808579

传真：0755-66892399

客户服务电话：400-9302-888

公司网址：[www.jfz.com](http://www.jfz.com)

61、珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

62、武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢  
23层1号4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城7栋2301

法定代表人：陶捷

联系人：徐博

电话：027-87006003-8015



客户服务电话：400-027-9899

公司网址：www.buyfunds.cn

63、上海中正达广投资管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉薇

联系电话：13774232592

客户服务电话：400-6767-523

公司网址：www.zzwealth.cn

64、北京植信基金销售公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠和南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：www.zhixin-inv.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（三）注册登记机构

名称：金元顺安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

法定代表人：任开宇

电话：021-68881801

传真：021-68881875

（四）律师事务所

名称：上海通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-68816880

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

(五) 会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

法人代表：葛明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：汤骏

经办注册会计师：汤骏、印艳萍

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2008 年 6 月 16 日《关于同意金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]810号)的核准。

### (一) 基金类型

混合型，灵活配置混合型证券投资基金

### (二) 基金的运作方式

契约型开放式

### (三) 基金存续期间

不定期

### (四) 募集情况

经安永大华会计师事务所有限责任公司验资，本次募集的净认购金额为 374,324,748.94 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 84,381.26 元人民币。上述资金已于 2008 年 9 月 2 日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行开立的金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管专户。本次募集有效认购总户数为 5921 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，本次募集期的有效认购份额 374,324,748.94 份，利息结转的基金份额 84,381.26 份，两项合计共 374,409,130.20 份基金份额，已全部计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。其中，公司前身金元比联基金管理有限公司于 2008 年 8 月 28 日运用自有资金通过代销渠道认购本基金 9,999,275.00 份(含募集期利息结转的份额，根据招募说明书的约定，认购费为 1000 元)，占本基金总份额的比例为 2.67%；本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为 2,110,206.97 份(含募集期利息结转的份额)，占本基金总份额的比例为 0.56%。按照有关法律规定，本基金在基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费等费用由管理人承担，不从基金资产中支付。

## 七、基金合同的生效

### (一) 基金合同生效时间

本基金基金合同已于 2008 年 9 月 3 日生效，自该日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### (二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 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并报送解决方案。

## 八、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购与赎回场所

本基金的销售机构包括本基金管理人和本基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。销售机构名单和联系方式见上述第五部分第(一)条。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。

### (二) 申购与赎回办理的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

### (三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、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、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### (四) 申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

## 2、申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

## 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

### （五）申购与赎回的数额限制

1、代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为1,000元人民币，代销机构另有规定的，从其规定；直销柜台直销机构个人投资者柜台直销首次最低申购金额为人民币1万元（含申购费），网上直销个人投资者首次最低申购金额为人民币1,000元（含申购费），追加申购的单笔最低限额均为人民币1,000元；机构投资者柜台直销首次最低申购金额为人民币50万元（含申购费），追加申购的单笔最低限额为人民币10,000元。已在直销柜台有认购本公司旗下开放式基金记录的个人投资者再次申购该基金及投资者以当期分配的基金收益转购该基金基金份额时不受申购最低金额的限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于500份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足100份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前2个工作日至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### （六）申购费与赎回费

#### 1、申购费（前端）

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，如下表所示，最高申购费率不超过1.5%。

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.5%
100 万 ≤ M < 500 万	1.0%

500万 $\leq$ M<1,000万	0.6%
M $\geq$ 1,000万每笔	1,000元

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

## 2、赎回费

本基金的赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
持有期 $\leq$ 1年	0.5%
1年<持有期 $\leq$ 2年	0.25%
持有期 $>$ 2年	0%

赎回费用由赎回人承担，赎回费中25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

### (七) 申购份数与赎回金额的计算

#### 1、本基金申购份额的计算

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

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金单位净值}。$$

举例说明：假定T日的基金份额净值为1.200元，申购金额10万元，计算如下：

适用申购费率为1.5%

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

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

$$\text{申购份数} = 98,522.17 / 1.200 = 82,101.81 \text{ 份}$$

## 2、本基金赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

举例说明：假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元，赎回份数分别为 10,000 份，各时期赎回金额如下：

持有期限	适用费率	赎回总金额	赎回费用	赎回金额
持有期≤1 年	0.5%	12,000	60	11,940
1 年<持有期≤2 年	0.25%	12,000	30	11,970
持有期>2 年	0%	12,000	0	12,000

## 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### （八）申购与赎回的注册登记

1、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。



2、投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- 3、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- 5、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- 1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、证券交易场所依法决定临时休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第 3 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资

者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

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，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

#### (十一) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

##### 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全额赎回或部分顺延赎回。

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

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

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，并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天,基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

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,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日的基金份额净值。

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。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续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。

### (十三) 基金的转换

为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

### (十四) 转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《金元顺安基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

### (十五) 定期定额投资计划

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

### (十六) 基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式,将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中,“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形;“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下,接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基

金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《金元顺安基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》的有关规定办理。

#### （十七）基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求或者基金份额持有人本人自愿要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 九、基金的投资

### (一) 投资目标

在“可持续成长投资”指导下,本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力,以“已投入资本回报率(Return on invested capital, ROIC)”为核心财务分析指标,主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司;力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选,在精细化风险管理的基础上构建优化组合,谋求基金资产长期持续稳定的合理回报。

### (二) 投资理念

成功的投资管理在于能够建立一套规范的、具有实践意义的分析与投资方法,使之得以贯彻执行并持之以恒是本基金的投资理念。基于此,本基金坚守以下各项守则:

- 1、清晰及严谨的投资程序
- 2、注重详实基本面研究的主动投资
- 3、寻找风险中蕴藏的机会
- 4、利用规范的风险管理系统构建投资组合

### (三) 投资范围

本基金主要投资于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的30%—80%,其中投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的80%,债券投资比例为基金资产的15%—65%,现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在10个交易日内做出调整以符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

### (四) 投资策略

本基金的投资将定性与定量分析贯穿于资产类别配置、行业资产配置、公司价值评估、投资组合构建的全过程之中,依靠坚实的基础分析和科学的金融工程模型,把握股票市场和债券市场的有利投资机会,构建最佳的投资组合,实现长期优于业绩基准的良好收益。

本基金的投资管理分为两个层次,第一个层次是资产类别配置,即基金资产在股票、

债券和现金三大资产类别间的配置；第二个层次是单个证券（包括股票和债券）的选择。在该层次中，本基金以宏观经济预测和行业趋势分析辅助股票选择。

### 1、资产类属配置

本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济发展趋势、金融市场的利率变化和经济运行周期的变动，进行积极的战略性资产类别配置。

本基金投资在股票、债券和现金三大类资产之间的灵活配置来源于以下三个方面：

#### （1）分析员对宏观经济发展趋势和宏观经济指标的分析与判断

分析员从研究国民经济发展状况入手，判断利率水平、通货膨胀率、货币供应量、国际收支等多元因素对中国证券市场的影响。

#### （2）分析员对股票市场和债券市场相对投资价值的评估

分析员主要借助“股权风险溢价模型（Equity Risk Premium Model, ERP）”分析类别资产的预期风险收益特征，得出科学的市场分析结论。股票资产的当前收益率以三阶段现金流折现模型中的隐含收益率为参考，债券资产的当前收益率以10年期的国债到期收益率为参考。

#### （3）数量分析员对股票市场、债券市场以及投资组合的风险评估与建议

本基金的资产配置决策参照数量分析员的风险评估建议，由数量分析员运用统计方法计算投资组合、股票市场、债券市场的风险水平以及各大类资产之间相对的风险水平，向投资决策委员会提交股票风险溢价水平、投资组合调整可能导致的风险变化的评估报告。

### 2、股票组合的构建和管理

在股票投资方面，本基金将数量模型与定性分析相结合，采取主动投资方法构建股票投资组合。具体而言，基于“自下而上”的原则，在“可持续成长投资”指导下，本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力，以“已投入资本回报率（Return on invested capital, ROIC）”为核心财务分析指标，将资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票纳入股票投资组合。在股票投资过程中，本基金同时以宏观经济预测和行业趋势分析为辅助。

#### （1）“可持续成长投资”的内涵

“可持续成长投资”为本基金股票组合构建的核心理念。“可持续成长”指导本基金股票投资决策的基本点是从“企业的增长性”与“增长的可持续性”两个维度进行股票的分析与筛选，判断企业持续增长的投资机会，最大程度实现基金资产的长期稳定增长。

本基金管理人深信，企业的“成长动力”来源于企业如何运用其可运用的资本，资本运用效率的高低决定了企业未来盈利是否可持续。基于此，本基金管理人认为，体现企业资本运用效率的指标——已投入资本回报率——是企业未来成长动力的综合反映指标。

已投入资本回报率为企业息税后经营性利润（NOPAT）与投资资金（有息负债加所有者权益）之比，其代表了投资资金的回报水平。总体上，已投入资本回报率分析可以帮助本基金识别出具有稳定盈利增长前景的企业，这些企业资产的内在价值往往会反映在其股票价格长期的稳定上涨之中。短期内可能由于一些市场投资者对一些事件的过度反应，使得这些企业的股票定价被低估，本基金将把握住这些股票的价值回归。

通过对企业盈利的增长性以及增长的可持续性两个维度的综合分析，本基金可以根据上市公司盈利增长的强弱以及上市公司在可持续性评判标准方面的表现，将上市公司分类归入四个象限：第一象限：增长强劲—可持续性高、第二象限：增长较强—可持续性较弱、第三象限：增长乏力—可持续性低、第四象限：增长较弱—可持续性较高。本基金重点专注位于第一象限的公司，并适当考察有可能向该象限改善的上市公司。相反，对于位于或向第三象限方向恶化的上市公司则采取回避的态度。

## （2）股票组合构建

本基金股票组合的构建经过如下六个步骤并最终形成股票投资组合：流动性筛选、根据 GICS 行业分类体系对 A 股上市公司进行行业划分、盈利增长性：盈利增长分析与筛选、盈利可持续性：已投入资本回报率分析、公司治理评估以及估值考量。

### 1) 流动性筛选

本基金按照一定日均成交额和流通市值标准对上市公司流动性进行初步筛选。在当前得市场条件下，本基金管理人采纳如下两个指标作为股票流动性筛选标准：90 个交易日日均成交额不低于 1,000 万元以及流通市值不低于 3 亿元。本基金将根据未来中国证券市场的发展规模、上市公司日均成交额和流通市值的变化情况，以及本基金资金规模，相应调整上述流动性筛选标准。

### 2) 根据 GICS 行业分类体系对 A 股上市公司进行行业划分

以摩根斯坦利与标准普尔联合发布的“全球行业分类标准（GICS）”，本基金管理人对 A 股上市公司进行行业划分。在具体分类过程中，为了使各行业内的上市公司具有可比性，本基金管理人将划分深度进行到 GICS 三级行业。

### 3) 盈利增长性：盈利增长分析与筛选

本基金主要通过数量模型进行盈利增长的筛选。为此，本基金的盈利增长分析指标

评价体系主要从盈利增长能力、盈利质量能力、盈利速度能力和盈利稳健能力四个方面对上市公司的盈利增长性进行分析。根据该盈利增长分析指标评价体系，本基金管理人可以得到每一上市公司所对应的分值，我们将高于行业平均分值的上市公司纳入可选范围。

同时，由于上市公司股价还受到诸多非数量化因素的影响，例如经济、行业的周期性波动、行业发展的结构性问题、政策法规等，因此，在进行数量分析的同时，投资管理团队将跟踪市场变化以及不断更新的信息，关注数据以外的因素。

此外，本基金管理人将根据市场变化趋势，以谨慎的态度定期或不定期地对数量模型进行适当地修正，以确保模型的有效性。

#### 4) 盈利可持续性：已投入资本回报率分析

已投入资本回报率是本基金股票组合构建的核心指标。本基金将使用本基金管理人自主开发的“ROIC 模型”来评估上市公司的资本运用效率。ROIC 模型是通过如下两个指标来考察上市公司的资本运用效率：一是“已投入资本回报率”，二是“加权平均资本成本(WACC)”。已投入资本回报率为企业息税后经营性利润(NOPAT)与投资资金(有息负债加所有者权益)之比率，其代表了投资资金的回报水平。加权平均资本成本为企业有息负债成本和权益成本的加权平均，其代表了企业资本运用的代价。只有那些已投入资本回报率高、加权平均资本成本低的企业才被认为是有效地运用了其可得资本的企业。

在第三步盈利增长分析与筛选的基础上，本基金管理人通过上述两个指标把股票分类归入四个象限：第一象限：ROIC 高—WACC 高、第二象限：ROIC 高—WACC 低、第三象限：ROIC 低—WACC 低、第四象限：ROIC 低—WACC 高。本基金将选择第二象限“ROIC 高、WACC 低”的股票，从而确定可投资的股票组合。同时，本基金管理人将适当考察有可能向该象限改善的上市公司。相反，对于位于或向第四象限方向恶化的上市公司则采取回避的态度。

#### 5) 公司治理评估

在已投入资本回报率分析基础上，本基金将结合公司治理和估值水平以最终构建股票投资组合。为此，本基金从如下五个角度建立了中国上市公司公司治理评估体系，对上市公司的公司治理水平进行评估：企业的纪律性约束、对股东利益的关注、企业策略执行评估、企业的社会责任感以及持续创新能力。本基金管理人将以该评估体系为参照对 A 股上市公司进行综合评分，将综合评分在 60 分（包括 60 分）以上的上市公司纳入股票组合。



#### 6) 估值考量

本基金股票组合构建的最后一步为股票的估值考量,其目的在于确定股票的最终目标价格,以判断股票的内在价值和可能回报。投资价值的评估方法包括:绝对估值法下的自由现金流折现模型和股利折现模型以及相对估值法。本基金将选择估值吸引的上市公司股票。

#### 7) 动态监测与评估

上市公司的运营状况和盈利能力随着经济、政策、市场和环境的变化而处于不断地变化之中,因此本基金将对上市公司的上述各方面进行监测和评估,及时调整股票组合。

#### 8) 股票组合构建考虑的其他因素

在股票组合构建过程中,本基金亦将考虑以下因素:

##### 个股持仓量的政策限制

本基金将根据相关的法律、法规和基金合同等法律文件进行投资,杜绝违法、违规的现象。基金的相关文件对个别行业及个别股票的投资最高比重做出限制。

##### 分散投资和风险控制

参考数量化风险分析结果,确认主动性风险的来源,并将风险分解到各个层面,如资产类别、行业及股票,减少风险集中度,并不断地进行收益-风险最优化测试。

### 3、行业资产配置

本基金采用上述六个步骤精选出来的股票组合,完全是以自下而上方式构建而成的。这样的组合可能在单一行业集中度较高,造成组合的非系统风险较高。因此,本基金将主要利用“投资时钟”模型,通过建立“行业综合价值评估体系”,对产业环境、产业政策和竞争格局的分析和预测,确定行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值并据此对组合成份股的行业分布加以适当调整。

基本原则是,本基金对行业历史收益率和预期收益的分析,在行业间进行配置,使投资组合在控制风险的情况下,达到收益的最大化。

#### (1) 投资时钟

在一般意义上,投资时钟表明了在经济周期的不同阶段,各个行业的投资表现如何。比如,在经济发展停滞时,防御型的行业表现较为出色;在经济快速发展时,周期性的行业表现较为出色。另一方面,通常价值型的行业在货币政策紧缩时表现较佳,而成长型的行业在货币政策较宽松时,相对表现较好。

根据这一理论基础,本基金管理人建立了中国的行业研判的定量分析,从而得以观

察在不同的经济周期中行业相对表现的排列。

## (2) 行业综合价值评估体系和行业优化配置原则

### 1) 行业综合价值评估体系

在投资时钟模型对行业趋势研判的基础上,本基金管理人从如下四个角度通过建立“行业综合价值评估体系”来确定行业的投资价值:行业景气度、行业收入和利润增长、国际产业竞争力比较和估值比较。

### 2) 行业优化配置原则

本基金的行业优化配置采取以标普中国 A 股 300 指数 1 级和 2 级行业权重为基础、上下浮动的分散化投资策略。

分析员在上述行业综合价值评估体系的基础上,每月对全部行业的投资价值进行综合评分和排序,由此决定不同行业的投资权重。具体评分方法分为 5 个级别,即:“++”、“+”、“0”、“-”以及“--”。对于投资价值评估得分很高(++)或高(+)的若干行业,给予“增持”的评级,即在该行业原市场权重的基础上增加一定比例的投资;对于评分居中(0)的行业,本基金给予“中性”或“市场权重”的评级,即在资产配置时维持该行业的原市场权重;对于投资价值评估得分低(-)或很低(--)的若干行业,本基金给予“减持”的评级,即在该行业市场权重的基础上减少一定比例的投资。

## 4、债券组合的构建和管理

### (1) 债券投资策略

基于“自上而下”的原则,本基金采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。

### (2) 债券组合构建

本基金债券组合构建主要基于“自上而下”的原则,特别是对于国债、金融债、央行票据等品种的投资。在债券投资过程中,本基金将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析,并运用适当的策略来构建债券组合。

#### 1) 债券投资主要定量模型

本基金主要使用如下定量模型进行债券数据分析:宏观经济多因素回归模型、利率期限结构模型、组合构建模型、利差模型、信用风险评估体系。

#### 2) 债券投资主要策略

在债券资产配置方面,本基金采用类属配置、久期管理、收益率曲线配置、相对价

值配置等方法决定不同券种之间和不同期限券种之间的配置比例，制定债券资产配置方案。

#### 类属配置

通过对债券基准收益率的研究以及各类属债券之间利差的历史变化特征进行分析，寻找当前的市场投资机会。

#### 久期管理

债券分析员通过对 GDP 增长速度、财政政策和货币政策的变化、通货膨胀的变动趋势分析，运用数量模型判断未来利率走势，提出债券投资组合的久期的建议。

#### 收益率曲线配置

通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率和货币供应量等多种因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例。

#### 相对价值配置

在市场中寻找其他各个指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。在此策略中，本基金主要衡量这样几方面的指标：流动性、信用度、收益率等。

#### 企业债券投资

本基金注重单个企业债券品种信用风险的控制，并且结合流动性选择优质企业债券。

### (3) 债券选择

本基金的债券选择通过如下三个环节：数量小组初步筛选、债券分析员研究和集体讨论。

债券投资对象的选择标准包括但不限于：

#### 1) 信用度

信用评级在 BBB+ 以上，评级必须由国内外权威的专业评级机构做出；发行人如果是上市公司，不可以是 ST 或者 PT；有一份信用分析评价为“中性”以上的研究报告的企业债。

#### 2) 关联性

发行人和本基金管理人之间没有关联关系。

### (4) 投资决策主要依据

1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

2) 国际国内的宏观经济形势，主要指标有消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、进出口额和汇率等；

3) 债券市场各主要收益率曲线到期收益率数据；

4) 国内外权威专业机构的企业信用评级；

5) 国家财政和货币政策；

6) 国内金融机构信贷投放数据。

#### (5) 债券投资决策流程

1) 债券分析员每月撰写债券市场研究报告，对上月央行资金回笼情况、债券票据发行情况、债券市场走势等做出分析，对今后半年内收益率曲线的变化做出预测，对当月的债券组合久期提出建议，供投资决策委员会作为决策依据；

2) 投资决策委员会每月对债券组合的久期做出决策；

3) 基金经理根据投资决策委员会决定的久期来构建债券组合，根据市场利差情况决定债券组合中的类属配置；

4) 债券分析员通过对流动性和信用的分析向债券池中加入企业债券；

5) 基金经理从债券池中挑选合适的债券品种构建组合；

6) 交易室执行基金经理发出的交易指令；

7) 稽核部负责每日对债券组合的久期进行监控，允许组合久期在投资决策委员会规定久期的一定范围内有所偏离。

#### 5、权证投资策略

本基金将通过权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该投资品种的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。

#### 6、现金管理

在现金管理上，本基金基金经理通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

#### (五) 业绩比较基准

本基金选择标普中国 A 股 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩基准，选择中证综合债指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：

标普中国 A 股 300 指数×55%+中证综合债指数×45%。

本基金认为适合灵活配置混合型基金股票投资部分的业绩比较基准应符合以下条件:

- 1、覆盖沪深两个市场,能够反映两个市场的全貌;
- 2、应以成份股的可自由流通股数进行加权;
- 3、业绩基准的编制和发布应有一定的历史;
- 4、业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

如果今后市场出现更具代表性的投资基准,或更科学的复合指数权重比例,本基金可以在经过合适的程序后调整或变更业绩比较基准。

#### (六) 风险收益特征

本基金是一只主动投资的灵活配置混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金、保本型基金与货币市场基金,属于中等风险中等收益的证券投资基金品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。

#### (七) 投资决策依据

- 1、国家有关法律法规、基金合同和本基金管理人内部相关制度的有关规定;
- 2、宏观经济、产业状况、上市公司基本面及相关政策等可能的影响因素;
- 3、可投资品种的预期风险、预期收益水平。

#### (八) 投资决策流程

本基金的投资决策流程如下:

本基金管理人内部建立了包括投资决策委员会、基金管理部、研究部、数量分析及集中交易室等在内的完整投资管理体系。

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

#### (九) 投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1、本基金股票资产投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%;

2、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%;

3、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

4、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

5、本基金参与股票发行申购,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;

6、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;

7、本基金投资股权分置改革中产生的权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例,遵从法律法规或监管部门的相关规定;

8、本基金投资资产支持证券的,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%;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,不得超过该基金资产净值的 10%;基金管理人管理的全部证券投资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%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的 20%;

9、本基金投资债券的信用评级在 BBB+ 以上;

10、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

11、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 1—3 项以及 5—9 项规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

#### (十) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (十一) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (十二) 基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

#### (十三) 基金投资组合报告

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2017年9月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。

## 1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比(%)
1	权益投资	6,188,321.85	30.73
	其中: 股票	6,188,321.85	30.73
2	固定收益投资	3,414,096.77	16.96
	其中: 债券	3,414,096.77	16.96
	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	10,449,217.37	51.90
7	其他各项资产	83,492.35	0.41
8	合计	20,135,128.34	100.00

## 2、期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	454,201.00	2.31
C	制造业	2,261,513.60	11.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-



H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,472,607.25	17.69
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,188,321.85	31.52

### 3、期末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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	38,025	1,886,420.25	9.61
2	600276	恒瑞医药	24,840	1,256,655.60	6.40
3	600036	招商银行	42,400	1,013,784.00	5.16
4	002669	康达新材	20,500	579,535.00	2.95
5	601601	中国太保	16,900	572,403.00	2.92
6	600547	山东黄金	15,700	454,201.00	2.31
7	600887	伊利股份	19,700	425,323.00	2.17
8	-	-	-	-	-

9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

#### 4、期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,397,360.00	12.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,009,400.00	5.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,336.77	0.04
8	其他	-	-
9	合计	3,414,096.77	17.39

#### 5、期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019546	16 国债 18	24,000	2,397,360.00	12.21
2	088040	08 铁路 01	10,000	1,009,400.00	5.14
3	123001	蓝标转债	70	7,336.77	0.04
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8、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

本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本基金本期投资的前十名证券中有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

关于中国平安(代码:601318)的处罚说明

2017年2月22日中国证券监督管理委员会深圳监管局对敖翔涉嫌违法买卖股票案进行了调查、审理,并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据以及当事人依法享有的权利。

经查明,敖翔存在以下违法事实:

敖翔于2008年4月至2011年11月在平安证券有限责任公司投资银行部门任职,2011年11月至2015年3月在齐鲁证券有限公司(现更名为中泰证券股份有限公司)投资银行部门任职;2015年4月至调查日(2016年5月6日)在华泰联合证券有限责任公司投资银行部门任职。

“徐某珍”账户于2010年9月20日开立世纪证券有限责任公司樟树富通街证券营业部,资金账号19\*\*\*\*33,下挂上海股东账A31\*\*\*\*\*38和深圳股东账户01\*\*\*\*\*89;2014

年12月10日开通融资融券业务,信用资金账户为90\*\*\*\*44,下挂深A信用证券账户06\*\*\*\*\*56和沪A信用证券账户E02\*\*\*\*\*18。

敖翔在上述证券公司任职期间,利用“徐某珍”账户通过网上委托、手机委托等方式交易“中国平安”、“欣旺达”、“金城股份”等多只股票。经查,“徐某珍”账户累计转入资金6,056,900元,转出资金5,916,054.8元,累计买入金额25,916,482.17元,卖出金额25,775,796.68元,合计亏损140,685.49元。截至调查日,“徐某珍”账户无期末持股,资金余额159.71元。在案件调查过程中,敖翔能积极配合调查。

上述违法事实,有任职情况说明、相关证券账户资料、证券交易记录、银行账户流水和询问笔录等证据在案证明。

敖翔的上述行为违反了《证券法》第四十三条“证券交易所、证券公司和证券登记结算机构的从业人员、证券监督管理机构的工作人员以及法律、行政法规禁止参与股票交易的其他人员,在任期或者法定限期内,不得直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票,也不得收受他人赠送的股票”的规定,构成了《证券法》第一百九十九条所述违法行为。

敖翔在陈述和申辩材料中提出,“徐某珍”账户由其父亲敖某生2010年开立并独立控制,资金主要来源于父亲的积蓄,自己也将部分闲置资金借给父亲,但对父亲开立并使用“徐某珍”账户炒股并不知情。直至2014年初,才知晓父亲使用“徐某珍”账户炒股的事实,并协助父亲进行了少量股票操作。愿对自己的行为承担责任,请求考虑上述情况酌情处理。

我局认为,根据在案证据,敖翔与其父亲2010年开始在上海共同居住生活,“徐某珍”账户开立后,即通过敖翔多个银行账户转入多笔资金,资金主要来源于敖翔及其夫妻共同财产;资金转出主要去向为敖翔夫妻、其他个人和企业,用于敖翔家庭日常生活消费以及敖翔对外投资、借给朋友和支付离婚协议费用等。“徐某珍”账户网上委托交易使用多个MAC地址,对应的IP地址分布在北京、上海、杭州、无锡、南通、南昌和丽江等地,同时还有多笔敖翔通过手机下单的交易记录。敖翔所称其父亲在上海家中使用单一MAC地址下单交易、自己在2014年初之后才知道“徐某珍”账户并仅协助进行少量股票操作的说法与上述事实明显不符。敖翔在接受调查时承认利用“徐某珍”账户进行股票交易,并称融资融券账户都由其操作。综合本案情况,虽然不排除敖某生可能使用“徐某珍”账户进行了股票交易,但在案证据足以认定敖翔主要控制和利用“徐某珍”账户进行股票交易的违法事实。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券法》第一百九十九条的规定,我局决定:对敖翔处以10万元罚款。

当事人应自收到本处罚决定书之日起15日内,将罚款汇交中国证券监督管理委员会(开户银行:中信银行总行营业部,账号:7111010189800000162,由该行直接上缴国库),并将注有当事人名称的付款凭证复印件送中国证券监督管理委员会稽查局和深圳证监局备案。当事人如对本处罚决定不服,可在收到本处罚决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会

会申请行政复议,也可在收到本处罚决定书之日起6个月内直接向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间,上述决定不停止执行。

现作出说明如下:

A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念,看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件是公司下属子公司平安证券一名部门员工利用个人账户参与股票市场交易而违规,是该员工的个人行为。我们判断此次事件对公司无任何影响,公司生产经营活动一切正常,我们认为不会对整体的业绩造成影响。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,747.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,734.53
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,492.35

(4) 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	7,336.77	0.04

(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	002669	康达新材	579,535.00	2.95	发行股份购买资产

## (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## (十四) 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。基金业绩数据截至2016年12月31日。

## 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008-9-3至 2008-12-31	2.90%	0.74%	-8.27%	1.71%	11.17%	-0.97%
2009-1-1至 2009-12-31	33.65%	1.54%	46.90%	1.11%	-13.25%	0.43%
2010-1-1至 2010-12-31	-6.47%	1.15%	-4.38%	0.86%	-2.09%	0.29%
2011-1-1至 2011-12-31	-25.68%	0.94%	-12.93%	0.71%	-12.75%	0.23%
2012-1-1至 2012-12-31	2.14%	1.05%	5.95%	0.69%	-3.81%	0.36%
2013-1-1至 2013-12-31	5.06%	1.35%	-2.08%	0.76%	7.14%	0.59%
2014-1-1至 2014-12-31	28.67%	1.20%	28.35%	0.65%	0.32%	0.55%
2015-1-1至 2015-12-31	15.16%	2.35%	5.91%	1.33%	9.25%	1.02%

2016-1-1至 2016-12-31	-25.22%	1.33%	-4.30%	0.74%	-20.92%	0.59%
2017-1-1至 2017-6-30	3.82%	0.46%	6.69%	0.32%	-2.87%	0.14%
自基金合同 生效日至今	18.02%	1.37%	61.54%	0.91%	-43.52%	0.46%

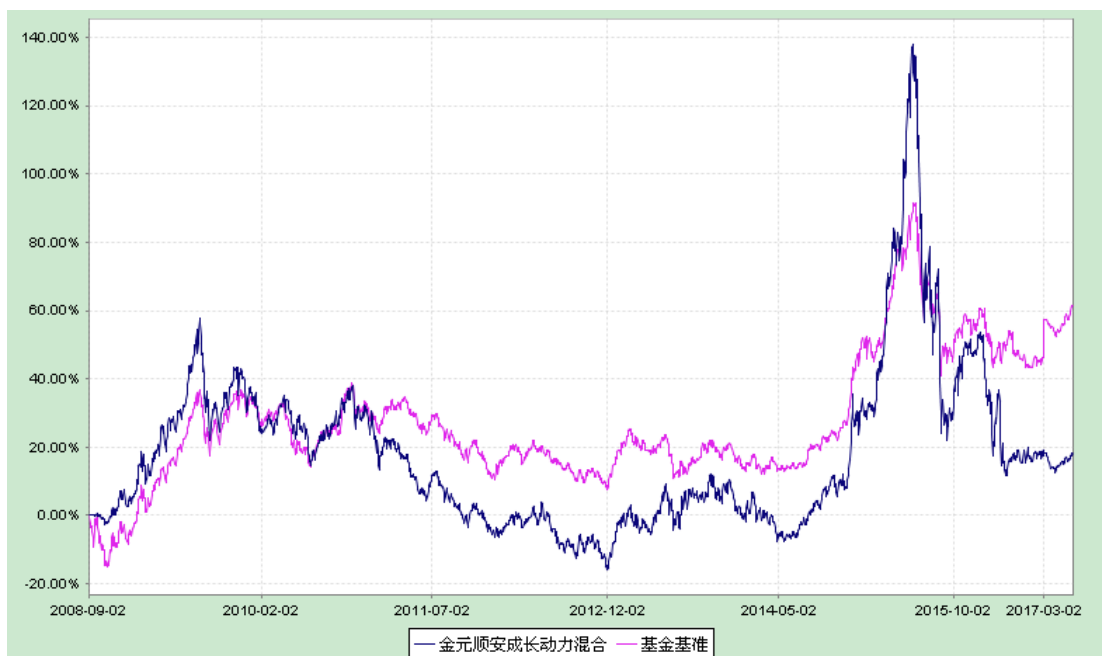
重要提示:

(1) 上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;

(2) 业绩比较基准: 标普中国 A 股 300 指数×55%+中证综合债指数×45%; (3) 业绩比较基准日期为 2008 年 9 月 2 日, 即以基金合同生效日前一收盘价格为计算基数;

(3) 数据截止日期为 2017 年 6 月 30 日。

2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



## 十、基金的财产

### (一) 基金资产总值

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

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的金额。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。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入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

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消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 十一、基金资产的估值

### (一) 估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### (二) 估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### (三) 估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### (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；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

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上市的同一股票的市价进行估值；

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，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

4) 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在正常情况下，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，有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，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) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法:

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如果估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值; 如果估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本进行后续计量。

(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) 在正常情况下, 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, 有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的, 基金管理人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基础上形成的债券估值, 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。

(8) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

## 3、权证估值办法:

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

(2) 首次发行未上市的权证, 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，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在正常情况下，基金管理人如采用本项第(1) — (3)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，有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，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。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方承担;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正;

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责;

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式;

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;

(7) 按法律法规规定的其他方式处理差错。

## 3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册

登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人（封闭式基金为每周五）。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （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、权证估值方法的第（4）项、股票指数期货合约估值方法的第（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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十二、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金财产拨划支付的银行费用；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%，其中，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%，其中，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值。

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、上述（一）中 3 到 7 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。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不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。



### 十三、基金的收益分配

#### (一) 基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。
- 5、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

#### (二) 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、本基金收益每年最多分配 4 次，全年基金收益分配比例不低于年度可供分配收益的 50%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### (五) 收益分配的时间和程序

- 1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办

法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并在报中国证监会备案:

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

#### (六) 收益分配中发生的费用

红利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,基金注册登记机构可将投资者的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 十四、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、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书面确认。

### (二) 基金的审计

- 1、基金管理人聘请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对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后的2日内公告。

## 十五、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证基金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。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、招募说明书、基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1) 招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后,基金管理人在每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媒体和基金管理人网站上;基金管理人在公告的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。

(2) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益事项的法律文件。

(3) 托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体和基金管理人网站上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

## 4、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2日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 5、基金资产净值、基金份额净值公告

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

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、申购赎回代理机构以及其他媒介,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体和基金管理人网站上。

## 7、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

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媒体和基金管理人网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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媒体和基金管理人网站上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

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。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

## 8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- (14) 重大关联交易事项;
- (15) 基金收益分配事项;
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
- (18) 基金改聘会计师事务所;
- (19) 基金变更、增加或减少销售代理机构;
- (20) 基金更换登记结算机构;
- (21) 本基金开始办理申购、赎回;
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请;
- (24) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请;
- (25) 基金推出新业务或服务;
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

在本基金合同存续期限内,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。

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

## 11、中国证监会规定的其他信息。

### (六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

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，以供公众查阅、复制。

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。



## 十六、风险揭示

本基金是一只主动投资的灵活配置混合型基金，风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、保本型基金与货币市场基金，属于中高风险的证券投资基金品种。本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度灵活配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报。

本基金面临的主要风险有市场风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险等。

### （一）市场风险

证券市场价格因受政治、经济、投资心理以及交易制度等因素的影响会产生波动，从而对本基金投资产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策及股权分置改革与非流通股流通政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，随着宏观经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也会随之变化，从而对基金收益产生影响。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本，并在一定程度上影响上市公司的盈利水平。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过深入研究和投资多样化来规避和分散这种非系统风险，但不能完全规避。

#### 5、信用风险

主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

#### 6、购买力风险

基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### 7、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### 8、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

#### 9、国际竞争风险

随着中国市场开放程度的日趋提高，我国上市公司的发展必然会面临来自于国际市场具有同类技术、同类产品上市公司的强有力竞争，有些上市公司可能会因这种竞争而导致业绩下滑，由此可能会导致公司股票的价格下降，从而影响本基金的收益水平。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的赎回。由于开放式基金在国内刚刚起步，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。另外，固定收益证券相对于股票而言，市场的流动性较低，从而使投资者在买卖证券时，较难获得合理的价格或者要付出更高的费用。对于个别证券，买入价与卖出价之间的价差是反映流动性的重要指标。

### （四）本基金的特定风险

本基金主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票。本基金特定风险主要包括：1、投资管理人对市场判断有误从而导致资产配置比例不合适而产

生的风险；2、本基金使用“股票盈利增长分析指标评价体系”和“ROIC模型”进行选股，使用的指标、分值、计算方法的选取不当会影响组合中股票构成与投资业绩；3、股票研究不深入与业绩预测不准确带来的风险。在本基金的选股方法中，使用了预测性的指标，包括当年的净利润增长率、预期中长期净利润增长率、预期中长期每股收益增长率、预期市盈率等，如果研究不深入、业绩预测不准确会增加投资风险。

#### （五）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### （六）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

2、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

4、因业务竞争压力可能产生的风险；

5、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

6、其他意外导致的风险。

## 十七、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、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 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；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- (1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；
- (2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；
- (3) 因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

### (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；

- 2、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；
- 4、基金合并；
- 5、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

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3、清算费用

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

#### 4、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) — (3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 6、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。

## 十八、基金合同内容摘要

### (一) 基金的基本情况

#### 1、基金的名称

金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金

#### 2、基金的类别

混合型，灵活配置混合型证券投资基金

#### 3、基金的运作方式

契约型开放式

#### 4、基金的投资目标

在“可持续成长投资”指导下，本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力，以“已投入资本回报率（Return on invested capital, ROIC）”为核心财务分析指标，主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选，在精细化风险管理的基础上构建优化组合，谋求基金资产长期持续稳定的合理回报。

#### 5、基金的最低募集份额总额和金额

本基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。

#### 6、基金募集规模

本基金不设募集规模上限。

#### 7、基金份额面值和认购费用

基金份额发售面值为人民币1.00元。

本基金的认购费率最高不超过1.0%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

#### 8、基金存续期限

不定期

### (二) 基金当事人的权利与义务

#### 1、基金管理人

##### (1) 基金管理人简况

名称：金元顺安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

邮政编码：200120

法定代表人：任开宇先生

成立时间：2006年11月13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[2006]222号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.45亿元人民币

存续期间：持续经营

## （2）基金管理人的权利

1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2) 获得基金管理人报酬；

3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

7) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

10) 依法召集基金份额持有人大会；

11) 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;

12) 根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金融资、融券;

13) 法律法规规定的其他权利。

(3) 基金管理人的义务

1) 依法募集基金,办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;

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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

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

5) 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财产分别管理,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) 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12) 编制中期和年度基金报告;

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,不得泄露基金投资计划、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保密,不得向他人泄露;

15) 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;

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

17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年

以上;

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者实施其他法律行为;

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合法权益, 应当承担赔偿责任, 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) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23) 建立并保存基金份额持有人名册;

24) 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;

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动;

27) 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, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 2、基金托管人

### (1) 基金托管人简况

名称: 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: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心

法定代表人: 刘士余

成立时间: 2009 年 1 月 15 日

注册资金: 32,479,411.7 万元人民币

存续期间: 持续经营

基金托管资格批准文号: 中国证监会证监基字[1998]23 号

### (2) 基金托管人的权利

- 1) 获得基金托管费;
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- 3) 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金财产;
- 4) 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益;

- 6) 依法召集基金份额持有人大会;
- 7) 按规定取得基金份额持有人名册;
- 8) 法律法规规定的其他权利。

### (3) 基金托管人的义务

- 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, 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; 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

4) 除依据《基金法》、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, 不得委托第三人托管基金财产;

- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

7) 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保密, 不得向他人泄露;

8) 对基金财务会计报告、中期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;

- 9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年;

- 10) 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;

- 11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

- 12) 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;
- 13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 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) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务, 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- 19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;
- 20) 参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和中国银监会, 并通知基金管理人;
- 22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- 23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### 3、基金份额持有人

基金投资者自依招募说明书、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, 直至其不再持有本基金的基金份额, 其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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》及其他有关法律法规的规定, 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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

4、本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

### (三) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

#### 2、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) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；

- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- 8) 本基金与其他基金的合并;
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响, 需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的, 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) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用;
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率;
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- 4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

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

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

(3) 代表基金份额 10% 以上 (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

有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

#### 4、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) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

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

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交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书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。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，不影响计票和表决结果。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

- 1) 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。
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现

场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A.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应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

B.亲自出席会议者持有基金份额持有人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及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

B.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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

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

D.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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

6、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权



1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

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

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

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

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

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，

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

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## 2) 通讯方式开会

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

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列（2）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

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

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集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和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

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

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒体和基金管

理人网站公告。

(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。

#### 4、基金的收益分配原则、执行方式

##### (1) 基金收益的构成

- 1) 买卖证券差价;
- 2) 基金投资所得红利、股息、债券利息;
- 3) 银行存款利息;
- 4) 已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

##### (2) 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

##### (3) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

- 1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
- 2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;
- 3) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担;
- 4) 基金投资当期出现净亏损, 则不进行收益分配;
- 5) 基金当期收益应先弥补上期累计亏损后, 才可进行收益分配;
- 6) 本基金收益每年最多分配 4 次, 全年基金收益分配比例不低于年度可供分配收益的 50%; 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- 7) 本基金收益分配方式分为两种: 现金分红与红利再投资, 基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- 8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

##### (4) 收益分配方案

基金收益分配方案中应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、支付方式等内容。

#### (5) 收益分配的时间和程序

1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定,基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

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

#### (6) 收益分配中发生的费用

1) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担;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,注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

### 5、基金的费用与税收

#### (1) 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) 基金合同生效后的信息披露费用;
- 4) 基金份额持有人大会费用;
- 5) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
- 6) 基金的证券交易费用;
- 7) 基金财产拨划支付的银行费用;
- 8) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

#### (2) 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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下: $H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ ,本基金年管理费率为1.5%,其中,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,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日,支付日期顺延。

## 2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为0.25%，其中，H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值。

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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3) 上述（一）中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （4）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金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不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（5）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

## （6）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 6、基金财产的投资方向和投资限制

### （1）投资目标

在“可持续成长投资”指导下，本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力，以“已投入资本回报率（Return on invested capital, ROIC）”为核心财务分析指标，主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选，在精细化风险管理的基础上构建优化组合，谋求基金资产长期持续稳定的合理回报。

### （2）投资理念

成功的投资管理在于能够建立一套规范的、具有实践意义的分析与投资方法，使之得以贯彻执行并持之以恒」是本基金的投资理念。基于此，本基金坚守以下各项守则：

#### 1) 清晰及严谨的投资程序；

- 2) 注重详实基本面研究的主动投资;
- 3) 寻找风险中蕴藏的机会;
- 4) 利用规范的风险管理系统构建投资组合。

### (3) 投资范围

本基金主要投资于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 30%—80%,其中投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%,债券投资比例为基金资产的 15%—65%,现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在 10 个工作日内做出调整以符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

### (4) 投资策略

本基金的投资将定性与定量分析贯穿于资产类别配置、行业资产配置、公司价值评估、投资组合构建的全过程之中,依靠坚实的基础分析和科学的金融工程模型,把握股票市场和债券市场的有利投资机会,构建最佳的投资组合,实现长期优于业绩基准的良好收益。

本基金的投资管理分为两个层次,第一个层次是资产类别配置,即基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置;第二个层次是单个证券(包括股票和债券)的选择。在该层次中,本基金以宏观经济预测和行业趋势分析辅助股票选择。

#### 1) 资产类属配置

本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略,根据宏观经济发展趋势、金融市场的利率变化和经济运行周期的变动,进行积极的战略性资产类别配置。

本基金投资在股票、债券和现金三大类资产之间的灵活配置来源于以下三个方面:

##### A. 分析员对宏观经济发展趋势和宏观经济指标的分析与判断

分析员从研究国民经济发展状况入手,判断利率水平、通货膨胀率、货币供应量、国际收支等多元因素对中国证券市场的影响。

##### B. 分析员对股票市场和债券市场相对投资价值的评估

分析员主要借助“股权风险溢价模型(Equity Risk Premium Model, ERP)”分析类别资产的预期风险收益特征,得出科学的市场分析结论。股票资产的当前收益率以三阶

段现金流折现模型中的隐含收益率为参考，债券资产的当前收益率以 10 年期的国债到期收益率为参考。

### C.数量分析员对股票市场、债券市场以及投资组合的风险评估与建议

本基金的资产配置决策参照数量分析员的风险评估建议，由数量分析员运用统计方法计算投资组合、股票市场、债券市场的风险水平以及各大类资产之间相对的风险水平，向投资决策委员会提交股票风险溢价水平、投资组合调整可能导致的风险变化的评估报告。

## 2) 股票组合的构建和管理

在股票投资方面，本基金将数量模型与定性分析相结合，采取主动投资方法构建股票投资组合。具体而言，基于“自下而上”的原则，在“可持续成长投资”指导下，本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力，以“已投入资本回报率（Return on invested capital, ROIC）”为核心财务分析指标，将资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票纳入股票投资组合。在股票投资过程中，本基金同时以宏观经济预测和行业趋势分析为辅助。

### A. “可持续成长投资”的内涵

“可持续成长投资”为本基金股票组合构建的核心理念。“可持续成长”指导本基金股票投资决策的基本点是从“企业的增长性”与“增长的可持续性”两个维度进行股票的分析与筛选，判断企业持续增长的投资机会，最大程度实现基金资产的长期稳定增长。

本基金管理人深信，企业的“成长动力”来源于企业如何运用其可运用的资本，资本运用效率的高低决定了企业未来盈利是否可持续。基于此，本基金管理人认为，体现企业资本运用效率的指标——已投入资本回报率——是企业未来成长动力的综合反映指标。

已投入资本回报率为企业息税后经营性利润（NOPAT）与投资资金（有息负债加所有者权益）之比，其代表了投资资金的回报水平。总体上，已投入资本回报率分析可以帮助本基金识别出具有稳定盈利增长前景的企业，这些企业资产的内在价值往往会反映在其股票价格长期的稳定上涨之中。短期内可能由于一些市场投资者对一些事件的过度反应，使得这些企业的股票定价被低估，本基金将把握住这些股票的价值回归。

通过对企业盈利的增长性以及增长的可持续性两个维度的综合分析，本基金可以根据上市公司盈利增长的强弱以及上市公司在可持续性评判标准方面的表现，将上市公司分类归入四个象限：第一象限：增长强劲—可持续性强、第二象限：增长较强—可持续



性较弱、第三象限：增长乏力—可持续性弱、第四象限：增长较弱—可持续性较强。本基金重点专注位于第一象限的公司，并适当考察有可能向该象限改善的上市公司。相反，对于位于或向第三象限方向恶化的上市公司则采取回避的态度。

## B 股票组合构建

本基金股票组合的构建经过如下六个步骤并最终形成股票投资组合：流动性筛选、根据 GICS 行业分类体系对 A 股上市公司进行行业划分、盈利增长性：盈利增长分析与筛选、盈利可持续性：已投入资本回报率分析、公司治理评估以及估值考量。

### a.流动性筛选

本基金按照一定日均成交额和流通市值标准对上市公司流动性进行初步筛选。在当前得市场条件下，本基金管理人采纳如下两个指标作为股票流动性筛选标准：90 个交易日日内平均成交额不低于 1,000 万元以及流通市值不低于 3 亿元。本基金将根据未来中国证券市场的发展规模、上市公司日均成交额和流通市值的变化情况，以及本基金资金规模，相应调整上述流动性筛选标准。

### b.根据 GICS 行业分类体系对 A 股上市公司进行行业划分

以摩根斯坦利与标准普尔联合发布的“全球行业分类标准（GICS）”，本基金管理人对 A 股上市公司进行行业划分。在具体分类过程中，为了使各行业内的上市公司具有可比性，本基金管理人将划分深度进行到 GICS 三级行业。

### c.盈利增长性：盈利增长分析与筛选

本基金主要通过数量模型进行盈利增长的筛选。为此，本基金的盈利增长分析指标评价体系主要从盈利增长能力、盈利质量能力、盈利速度能力和盈利稳健能力四个方面对上市公司的盈利增长性进行分析。根据该盈利增长分析指标评价体系，本基金管理人可以得到每一上市公司所对应的分值，我们将高于行业平均分值的上市公司纳入可选范围。

同时，由于上市公司股价还受到诸多非数量化因素的影响，例如经济、行业的周期性波动、行业发展的结构性问题、政策法规等，因此，在进行数量分析的同时，投资管理团队将跟踪市场变化以及不断更新的信息，关注数据以外的因素。

此外，本基金管理人将根据市场变化趋势，以谨慎的态度定期或不定期地对数量模型进行适当地修正，以确保模型的有效性。

### d.盈利可持续性：已投入资本回报率分析

已投入资本回报率是本基金股票组合构建的核心指标。本基金将使用本基金管理人自主开发的“ROIC 模型”来评估上市公司的资本运用效率。ROIC 模型是通过如下两个

指标来考察上市公司的资本运用效率：一是“已投入资本回报率”，二是“加权平均资本成本(WACC)”。已投入资本回报率为企业息税后经营性利润(NOPAT)与投资资金(有息负债加所有者权益)之比，其代表了投资资金的回报水平。加权平均资本成本为企业有息负债成本和权益成本的加权平均，其代表了企业资本运用的代价。只有那些已投入资本回报率高、加权平均资本成本低的企业才被认为是有效地运用了其可得资本的企业。

在第三步盈利增长分析与筛选的基础上，本基金管理人通过上述两个指标把股票分类归入四个象限：第一象限：ROIC 高—WACC 高、第二象限：ROIC 高—WACC 低、第三象限：ROIC 低—WACC 低、第四象限：ROIC 低—WACC 高。本基金将选择第二象限“ROIC 高、WACC 低”的股票，从而确定可投资的股票组合。同时，本基金管理人将适当考察有可能向该象限改善的上市公司。相反，对于位于或向第四象限方向恶化的上市公司则采取回避的态度。

#### e. 公司治理评估

在已投入资本回报率分析基础上，本基金将结合公司治理和估值水平以最终构建股票投资组合。为此，本基金从如下五个角度建立了中国上市公司公司治理评估体系，对上市公司的公司治理水平进行评估：企业的纪律性约束、对股东利益的关注、企业策略执行评估、企业的社会责任感以及持续创新能力。本基金管理人将以该评估体系为参照对 A 股上市公司进行综合评分，将综合评分在 60 分（包括 60 分）以上的上市公司纳入股票组合。

#### f. 估值考量

本基金股票组合构建的最后一步为股票的估值考量，其目的在于确定股票的最终目标价格，以判断股票的内在价值和可能回报。投资价值的评估方法包括：绝对估值法下的自由现金流折现模型和股利折现模型以及相对估值法。本基金将选择估值吸引的上市公司股票。

#### g. 动态监测与评估

上市公司的运营状况和盈利能力随着经济、政策、市场和环境的变化而处于不断地变化之中，因此本基金将对上市公司的上述各方面进行监测和评估，及时调整股票组合。

#### h. 股票组合构建考虑的其他因素

在股票组合构建过程中，本基金亦将考虑以下因素：

个股持仓量的政策限制

本基金将根据相关的法律、法规和基金合同等法律文件进行投资，杜绝违法、违规

的现象。基金的相关文件对个别行业及个别股票的投资最高比重做出限制。

#### 分散投资和风险控制

参考数量化风险分析结果,确认主动性风险的来源,并将风险分解到各个层面,如资产类别、行业及股票,减少风险集中度,并不断地进行收益-风险最优化测试。

#### 3) 行业资产配置

本基金采用上述六个步骤精选出来的股票组合,完全是以自下而上方式构建而成的。这样的组合可能在单一行业集中度较高,造成组合的非系统风险较高。因此,本基金将主要利用“投资时钟”模型,通过建立“行业综合价值评估体系”,对产业环境、产业政策和竞争格局的分析和预测,确定行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值并据此对组合成份股的行业分布加以适当调整。

基本原则是,本基金对行业历史收益率和预期收益的分析,在行业间进行配置,使投资组合在控制风险的情况下,达到收益的最大化。

##### A. 投资时钟

在一般意义上,投资时钟表明了在经济周期的不同阶段,各个行业的投资表现如何。比如,在经济发展停滞时,防御型的行业表现较为出色;在经济快速发展时,周期性的行业表现较为出色。另一方面,通常价值型的行业在货币政策紧缩时表现较佳,而成长型的行业在货币政策较宽松时,相对表现较好。

根据这一理论基础,本基金管理人建立了中国的行业研判的定量分析,从而得以观察在不同的经济周期中行业相对表现的排列。

##### B. 行业综合价值评估体系和行业优化配置原则

###### a. 行业综合价值评估体系

在投资时钟模型对行业趋势研判的基础上,本基金管理人从如下四个角度通过建立“行业综合价值评估体系”来确定行业的投资价值:行业景气度、行业收入和利润增长、国际产业竞争力比较和估值比较。

###### b. 行业优化配置原则

本基金的行业优化配置采取以标普中国 A 股 300 指数 1 级和 2 级行业权重为基础、上下浮动的分散化投资策略。

分析员在上述行业综合价值评估体系的基础上,每月对全部行业的投资价值进行综合评分和排序,由此决定不同行业的投资权重。具体评分方法分为 5 个级别,即:“++”、“+”、“0”、“-”以及“- -”。对于投资价值评估得分很高(++)或高(+)

的若干行业，给予“增持”的评级，即在该行业原市场权重的基础上增加一定比例的投资；对于评分居中（0）的行业，本基金给予“中性”或“市场权重”的评级，即在资产配置时维持该行业的原市场权重；对于投资价值评估得分低（-）或很低（--）的若干行业，本基金给予“减持”的评级，即在该行业市场权重的基础上减少一定比例的投资。

#### 4) 债券组合的构建和管理

##### A. 债券投资策略

基于“自上而下”的原则，本基金采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。

##### B. 债券组合构建

本基金债券组合构建主要基于“自上而下”的原则，特别是对于国债、金融债、央行票据等品种的投资。在债券投资过程中，本基金将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析，并运用适当的策略来构建债券组合。

##### a. 债券投资主要定量模型

本基金主要使用如下定量模型进行债券数据分析：宏观经济多因素回归模型、利率期限结构模型、组合构建模型、利差模型、信用风险评估体系。

##### b. 债券投资主要策略

在债券资产配置方面，本基金采用类属配置、久期管理、收益率曲线配置、相对价值配置等方法决定不同券种之间和不同期限券种之间的配置比例，制定债券资产配置方案。

##### 类属配置

通过对债券基准收益率的研究以及各类属债券之间利差的历史变化特征进行分析，寻找当前的市场投资机会。

##### 久期管理

债券分析员通过对 GDP 增长速度、财政政策和货币政策的变化、通货膨胀的变动趋势分析，运用数量模型判断未来利率走势，提出债券投资组合的久期的建议。

##### 收益率曲线配置

通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率和货币供应量等多种因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例。

### 相对价值配置

在市场中寻找其他各个指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。在此策略中，本基金主要衡量这样几方面的指标：流动性、信用度、收益率等。

### 企业债券投资

本基金注重单个企业债券品种信用风险的控制，并且结合流动性选择优质企业债券。

### C.债券选择

本基金的债券选择通过如下三个环节：数量小组初步筛选、债券分析员研究和集体讨论。

债券投资对象的选择标准包括但不限于：

#### a.信用度

信用评级在 **BBB+** 以上，评级必须由国内外权威的专业评级机构做出；发行人如果是上市公司，不可以是 **ST** 或者 **PT**；有一份信用分析评价为“中性”以上的研究报告的企业债。

#### b.关联性

发行人和本基金管理人之间没有关联关系。

### D.投资决策主要依据

a.国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

b.国际国内的宏观经济形势，主要指标有消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、进出口额和汇率等；

c.债券市场各主要收益率曲线到期收益率数据；

d.国内外权威专业机构的企业信用评级；

e.国家财政和货币政策；

f.国内金融机构信贷投放数据。

### E.债券投资决策流程

a.债券分析员每月撰写债券市场研究报告，对上月央行资金回笼情况、债券票据发行情况、债券市场走势等做出分析，对今后半年内收益率曲线的变化做出预测，对当月的债券组合久期提出建议，供投资决策委员会作为决策依据；

b.投资决策委员会每月对债券组合的久期做出决策；

c.基金经理根据投资决策委员会决定的久期来构建债券组合，根据市场利差情况决

定债券组合中的类属配置；

d.债券分析员通过对流动性和信用的分析向债券池中加入企业债券；

e.基金经理从债券池中挑选合适的债券品种构建组合；

f.交易室执行基金经理发出的交易指令；

g.稽核部负责每日对债券组合的久期进行监控，允许组合久期在投资决策委员会规定久期的一定范围内有所偏离。

#### 5) 权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该投资品种的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。

#### 6) 现金管理

在现金管理上，本基金基金经理通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

#### (5) 业绩比较基准

本基金选择标普中国 A 股 300 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择中证综合债指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：

$$\text{标普中国 A 股 300 指数} \times 55\% + \text{中证综合债指数} \times 45\%$$

本基金认为适合灵活配置混合型基金股票投资部分的业绩比较基准应符合以下条件：

- 1) 覆盖沪深两个市场，能够反映两个市场的全貌；
- 2) 应以成份股的可自由流通股数进行加权；
- 3) 业绩基准的编制和发布应有一定的历史；
- 4) 业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

如果今后市场出现更具代表性的投资基准，或更科学的复合指数权重比例，本基金可以在经过合适的程序后调整或变更业绩比较基准。

#### (6) 风险收益特征

本基金是一只主动投资的灵活配置混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金、保本型基金与货币市场基金，属于中等风险中等收益的证券投资基金品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高

于业绩比较基准的单位风险收益值。

#### (7) 投资决策依据

- 1) 国家有关法律法规、基金合同和本基金管理人内部相关制度的有关规定；
- 2) 宏观经济、产业状况、上市公司基本面及相关政策等可能的影响因素；
- 3) 可投资品种的预期风险、预期收益水平。

#### (8) 投资决策流程

本基金的投资决流程如下：

本基金管理人内部建立了包括投资决策委员会、基金管理部、研究部、数量分析室及集中交易室等在内的完整投资管理体系。

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

#### (9) 投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1) 本基金股票资产投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%；
- 2) 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%；
- 3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- 5) 本基金参与股票发行申购，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；
- 6) 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；
- 7) 本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过

上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

8) 本基金投资资产支持证券的，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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

9) 本基金投资债券的信用评级在 BBB+ 以上；

10) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

11) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述（1）—（3）项以及（5）—（9）项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### （10）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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) 依照法律法规有关规定, 由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 履行适当程序后, 本基金投资可不受上述规定限制。

(11) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1) 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利, 保护基金份额持有人的利益;

2) 不谋求对上市公司的控股, 不参与所投资上市公司的经营管理;

3) 有利于基金财产的安全与增值;

4) 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(12) 基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(七) 基金资产净值的计算方法和公告方式

1、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值, 并为基金份额提供计价依据。

2、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日, 以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

3、估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

4、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; 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 以最近交易日的收盘价估值; 如果估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值:

A. 首次发行未上市的股票, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的前提下, 按成本价估值;

B.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上市的一股票的市价进行估值；

C.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，按估值日在证券交易所上市的一股票的市价进行估值；

D.非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 在正常情况下，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，有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当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) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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) 在正常情况下，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，有充足理由表明按以上估值原则

仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人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基础上形成的债券估值，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。

8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(3) 权证估值办法：

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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 首次发行未上市的权证，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，按成本估值。

3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 在正常情况下，基金管理人如采用本项第 1) —3) 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，有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，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。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(4) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

## 5、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 6、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### (1) 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### (2) 差错处理原则

1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方承担;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正;

2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责;

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

4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式;

5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人、基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;

6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金

合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;

7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### (3) 差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

4) 根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### (4) 基金份额净值差错处理的原则和方法

1) 当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时,视为基金份额净值错误;基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案;当发生净值计算错误时,由基金管理人负责处理,由此给基金份额持有人和基金造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时,基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任,经确认后按以下条款进行赔偿:

A. 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,与本基金有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金会计责任方的建议执行,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付;

B. 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明,份额净值出错且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,其中基金管理人承担50%,基金托管人承担50%;

C. 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核

对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付;

D.由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失,由基金管理人负责赔付。

3)基金管理人、基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

4)前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 7、暂停估值的情形

(1)基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2)因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

(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)中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 8、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人(封闭式基金为每周五)。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,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.001元,小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

#### 9、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、权证估值方法的第4)项、股票指数期货合约估值方法的第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)由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### (八) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、基金合同的变更

(1) 下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人和基金保证人；
- 7) 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；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- 1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；
- 2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；
- 3) 因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

##### 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的;
- (2) 基金管理人职责终止,而在6个月内没有新的基金管理人承接的;
- (3) 基金托管人职责终止,而在6个月内没有新的基金托管人承接的;
- (4) 基金合并;
- (5) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算小组

1) 基金合同终止时,成立基金清算小组,基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金清算小组成员由基金管理人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止时,由基金清算小组统一接管基金财产;
- 2) 对基金财产进行清理和确认;
- 3) 对基金财产进行估价和变现;
- 4) 制作清算报告;
- 5) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会;
- 8) 公布基金清算报告;
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 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) — 3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告; 清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算结果经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### (6) 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。

#### (九) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的, 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, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对当事人均有约束力。

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### (十) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字, 在基金募集结束, 基金备案手续办理完毕, 并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

2、本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

3、本基金合同正本一式六份, 除上报相关监管部门两份外, 基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

4、本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：金元顺安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

邮政编码：200120

法定代表人：任开宇先生

成立日期：2006年11月13日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]222号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2.45亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：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：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：刘士余

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资金：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

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

各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为：

本基金主要投资于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的配置比例为：

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 30%—80%，债券投资比例为基金资产的 15%—65%，现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

“可持续成长投资”为本基金股票组合构建的核心理念。可持续成长投资是从“企业的成长性”与“增长的可持续性”两个维度进行股票的分析与筛选，判断企业持续增长的投资机会。本基金从“盈利增长分析指标评价体系”和“ROIC 模型”两个方面剖析与把握上市公司的成长动力，以“已投入资本回报率（ROIC）”为核心财务分析指标，主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司。具有该特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%。

由于本基金股票资产的 80%投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司，因而基金管理人将每季度按照双方约定的形式向基金托管人提供相关股票库，并有责任确保该股票库符合基金合同的有关规定。基金托管人据此股票库监督本基金投资于

该类上市公司股票的比例。基金管理人对该股票库的临时调整（首次公开发行的股票除外）应及时发函通知基金托管人并加盖公司公章。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在 10 个交易日内做出调整以符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金股票资产投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%；

（2）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%；

（3）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，其市值不超过该证券的 10%；

（4）本基金参与股票发行申购，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；

（5）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（6）本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规有所修改，本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：

1）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 5%；

2）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%；

3）本基金与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）本基金投资资产支持证券目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规有所修改，本基金资产支持证券投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：

1）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%；

2）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，不得超过该基金资产净值的 10%；

3）本基金管理人管理的全部证券投资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%；

4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

(8) 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，以备支付基金份额持有人的赎回款项；

(9) 本基金投资债券的信用评级在 BBB+ 以上；

(10) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(11) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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比例不符合上述 1—3 项以及 5—9 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，本基金自上述限制被取消之日起，不再受上述限制约束。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任并向中国证监会报告。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、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。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 在投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4) 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前两个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

(5) 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

(6) 基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

(7) 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据或者出现其他影响基金托管人履行托管人监督职责的行为, 导致基金托管人不能履行托管人职责的, 基金管理人应承担相应法律后果, 包括但不限于承担基金托管人可能遭受的监管部门罚款以及基金托管人向基金份额持有人承担的赔偿。因投资流动受限证券产生的损失, 除依据法律法规的规定以及基金合同的约定应当由基金份额持有人承担的之外, 由基金管理人承担, 基金托管人不承担上述损失。如因基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求的原因导致本基金出现风险损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的, 基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。法律法规及监管机构另有规定的除外。

7、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事项, 基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

8、基金托管人发现基金管理人重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金管理人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的, 基金托管人应报告中国证监会。

### (三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括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、未执行或无故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《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金托管人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的, 基金管理人应报告中国证监会。



#### (四) 基金资产净值计算和会计核算

##### 1、基金资产净值的计算及复核程序

###### (1) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

###### (2) 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

##### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

###### (1) 估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

###### (2) 估值方法

###### 1) 股票估值方法：

A.上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

###### B.未上市股票的估值

a.首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

b.送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

c.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，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

d.公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

C.在正常情况下，基金管理人如采用本项第A.—B.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，有充足理由表明按以上估值原则仍不

能客观反映相关投资品种的公允价值的，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；

D.国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 2) 债券估值办法：

A.在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

B.在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

C.首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

D.交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

E.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。

F.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。

G.在正常情况下，基金管理人如采用本项第A.—F.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，有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人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基础上形成的债券估值，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。

H.国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3) 权证估值方法：

A.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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重

大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

B.首次发行未上市的权证,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,按成本估值。

C.因持有股票而享有的配股权,以及停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行估值。

D.在正常情况下,基金管理人如采用本项第 A.—C.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,有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,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。

E.国家有最新规定的,按其规定进行估值。

4) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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

### (3) 特殊情形的处理

基金管理人、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、权证估值方法的第 4) 项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

## 3、基金份额净值错误的处理方式

1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时,视为基金份额净值错误;基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;错误偏差达到或超过基金资产净值的 0.25%时,基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会;错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时,基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案;当发生净值计算错误时,由基金管理人负责处理,由此给基金份额持有人和基金造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时,基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任,经确认后按以下条款进行赔偿:

A.本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金会计责任方的建议执行,由此

给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

B.若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

C.如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

D.由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (4) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；

4) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

## 7、基金财务报表与报告的编制和复核

### (1) 财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 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 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。

### (2) 报表复核

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在 3 日内进行复核，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 7 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 30 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 45 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专用章的复核意见书，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中国证监会备案。

8、基金管理人应每周向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### (五) 基金费用

##### 1、基金管理费的计提比例和计提方法

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 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

##### 2、基金托管费的计提比例和计提方法

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

4、证券交易费用、基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、会计师费、律师费等根据有关法律法规、基金合同及相应协议的规定，列入当期基金费用。

##### 4、不列入基金费用的项目

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

##### 5、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

##### 6、基金管理费和基金托管费的复核程序、支付方式和时间

###### (1) 复核程序

基金托管人对基金管理人计提的基金管理费和基金托管费等，根据本托管协议和基金合同的有关规定进行复核。

## (2) 支付方式和时间

基金管理费、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管理费、基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人和基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

## 7、违规处理方式

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、《运作办法》及其他有关规定从基金财产中列支费用时,基金托管人可要求基金管理人予以说明解释,如基金管理人无正当理由,基金托管人可拒绝支付。

## (六) 基金管理人和基金托管人的更换

### 1、基金管理人的更换

#### (1) 基金管理人的更换条件

有下列情形之一的,经中国证监会核准,基金管理人职责终止:

- 1) 基金管理人被依法取消其基金管理资格的;
- 2) 基金管理人解散、依法撤销或依法宣告破产;
- 3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任;
- 4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### (2) 基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行:

- 1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人提名;
- 2) 决议: 基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任基金管理人形成决议,新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件;
- 3) 核准: 新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人。更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行;
- 4) 交接: 基金管理人职责终止的,应当妥善保管基金管理业务资料,及时办理基金管理业务的移交手续,新任基金管理人应当及时接收,并与基金托管人核对基金资产总值;
- 5) 审计: 基金管理人职责终止的,应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基

金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支；

6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告；

7) 基金名称变更：基金管理人退任后，应原任基金管理人要求，本基金应替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

## 2、基金托管人的更换

### (1) 基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- 1) 基金托管人被依法取消其基金托管资格的；
- 2) 基金托管人解散、依法撤销或依法宣布破产；
- 3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- 4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### (2) 基金托管人的更换程序

1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人。更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

4) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时与新任基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；

5) 审计：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；

6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告。

### (3) 基金管理人与基金托管人同时更换

1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；



3) 公告: 新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上联合公告。

3、新基金管理人接受基金管理或新基金托管人或接受基金财产和基金托管业务前, 原基金管理人或基金托管人应继续履行相关职责, 并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。

#### (七) 托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致, 可以对协议进行修改。修改后的新协议, 其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

##### 2、基金托管协议终止的情形

- (1) 本基金合同终止;
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

##### 3、基金财产的清算

###### (1) 基金财产清算小组

1) 基金合同终止后, 成立基金清算小组, 基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金清算小组成员由基金管理人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3) 在基金财产清算过程中, 基金管理人和基金托管人应各自履行职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务, 维护基金份额持有人的合法权益。

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

###### (2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止时, 由基金清算小组统一接管基金财产;
- 2) 对基金财产进行清理和确认;
- 3) 对基金财产进行估价和变现;
- 4) 编制清算报告;

- 5) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会;
- 8) 公布基金清算公告;
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

### (3) 清算费用

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

### (4) 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) — 3) 项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

### (6) 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) 基金托管协议的效力

双方对托管协议的效力约定如下:

1、基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的托管协议草案,应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字,协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会核准的文本为正式文本。

2、托管协议自基金合同成立之日起成立,自基金合同生效之日起生效。托管协议的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

3、托管协议自生效之日对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

4、本协议一式六份,协议双方各持二份,上报有关监管部门两份,每份具有同等

法律效力。

## 二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或修改这些服务项目。

### （一）电子版资料发送服务

在从销售机构获取准确的电子邮箱的前提下，基金管理人将负责发送以下电子版资料：

#### 1、基金交易对账单

根据投资人的定制内容，基金管理人向投资人发送基金交易电子对账单。基金交易电子对账单包括月度对账单、季度对账单与年度对账单。在每月结束后的5个工作日内向定制月度对账单的投资者发送月度对账单，在每季度结束后的5个工作日内向定制季度对账单的投资者发送季度对账单，在每年度结束后的5个工作日内向定制年度对账单的投资者发送年度对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

基金管理人将不定期为投资人发送其他相关的信息资料，如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告、基金周刊等。

### （二）基金投资类服务

#### 1、定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体业务规则以基金管理人的相关公告为准。

#### 2、基金电子交易服务

基金管理人通过本公司网站为投资者提供基金账户开立、基金认购、申购、赎回等各项业务。有关基金网上交易的具体业务规则以基金管理人的相关公告为准。

### （三）查询及修改服务

#### 1、信息查询

投资人可以通过基金管理人网站、客户服务中心查询基金管理人信息、基金产品信息、市场资讯信息、投资人基金账户信息等，并可以索取各种业务表格。

#### 2、信息修改

投资人可以通过基金管理人网站、客户服务中心人工坐席对其账户的地址、邮编、

电话、邮件地址和寄送状态信息进行修改。

#### （四）信息定制服务

基金投资人可以通过基金管理人网站、客户服务中心人工坐席提交信息定制申请并确定已预留了正确的电子邮件地址和手机号码，基金管理人将通过电子邮件、手机短信的形式定期或不定期的为投资人发送其所定制的信息。信息定制的内容包括基金份额净值、基金资讯信息、基金分红提示信息、定期基金报告和临时公告等。

#### （五）客户投诉处理

投资人可以通过基金管理人网站、客户服务中心电话、信函、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构进行投诉。对于投资人的投诉处理，基金管理人将秉承及时处理，及时回复的原则，对于无法及时回复的投诉，基金管理人也承诺将在3个工作日内给予信息反馈。

#### （六）服务联络方式

##### 1、客户服务中心电话

###### 1) 自助服务：

客户服务中心电话提供全天候7×24小时自助查询服务。

###### 2) 人工服务：

客户服务中心电话在每个交易日9:00—17:30为投资人提供人工坐席服务。

客户服务电话：4006660666

客户服务传真：021-68882865

##### 2、网上客户服务

公司网址：[www.jysa99.com](http://www.jysa99.com)

客户服务邮件地址：[service@jysa99.com](mailto:service@jysa99.com)

投诉专用邮件地址：[tousu@jysa99.com](mailto:tousu@jysa99.com)

## 二十一、其它应披露事项说明

1、2016年8月27日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告及摘要;

2、2016 年 10 月 17 日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书[2016 年 2 号]

3、2016年8月27日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要[2016 年 2 号]

4、2017年1月19日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金代销机构等的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复印件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十三、备查文件

(一) 备查文件包括:

- 1、中国证监会核准基金募集的文件
- 2、《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》
- 4、《金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式:

- 1、存放地点:《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式:投资者可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按工本费购买复印件。

金元顺安基金管理有限公司

二〇一六年十月十八日