

# 融通新蓝筹证券投资基金

## 更新招募说明书

(2019 年第 3 号)

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

日 期：二〇一九年十二月

## 重要提示

融通新蓝筹证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]41号文核准公开发售。核准日期为2002年7月25日。本基金为契约型开放式基金，基金合同生效日为2002年9月13日。

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

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金如投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，本基金并非必然投资于科创板股票。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金的基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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。

本更新招募说明书中有关信息披露的内容截止日为2019年12月13日；有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年6月30日（本招募说明书中的财务资料未经审计）；其他所载内容截止日为2019年9月13日。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

## 目 录

第一节 绪言.....	1
第二节 释义.....	2
第三节 基金管理人.....	5
第四节 基金托管人.....	13
第五节 相关服务机构.....	17
第六节 基金的募集.....	49
第七节 基金合同的生效.....	50
第八节 基金份额的申购、赎回与转换.....	51
第九节 基金的投资.....	64
1.1 报告期末基金资产组合情况.....	70
1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	70
1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....	71
1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71
1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细.....	72
1.7 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.....	72
1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	72
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
1.11 投资组合报告附注.....	72
第十节 基金的业绩.....	74
第十一节 基金的财产.....	75
第十二节 基金资产的估值.....	76
第十三节 基金收益的分配.....	81
第十四节 基金的费用与税收.....	82
第十五节 基金的会计与审计.....	83
第十六节 基金的信息披露.....	84
第十七节 基金的风险揭示.....	89
第十八节 基金的终止与清算.....	94
第十九节 基金合同的内容摘要.....	96
第二十节 基金托管协议的内容摘要.....	107
第二十一节 对基金份额持有人的服务.....	112
第二十二节 其他应披露的事项.....	114
第二十三节 招募说明书的存放及查阅方式.....	116
第二十四节 备查文件.....	117

## 第一节 绪言

《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书（更新）》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》及其他有关规定编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本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。基金投资人自依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。

## 第二节 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语代表如下含义：

基金或本基金：	指融通新蓝筹证券投资基金（简称：融通新蓝筹混合基金）
基金合同或《基金合同》：	指《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何修订和补充
发售公告：	指《融通新蓝筹证券投资基金份额发售公告》
更新招募说明书：	指基金合同生效后对《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》的更新
《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，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，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
《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
《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
《信息披露办法》：	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《流动性风险管理规定》：	指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指融通基金管理有限公司
基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司
直销机构：	指融通基金管理有限公司
其他销售机构：	指接受融通基金管理有限公司委托办理本基金销售业务的机构

销售机构：	指直销机构及其他销售机构
个人投资者：	指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证、护照等身份证件的中国居民
机构投资者：	指在中华人民共和国境内合法登记注册或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织和合格境外机构投资者
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》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
注册登记人：	本基金的注册登记人为融通基金管理有限公司
存续期：	指基金合同生效并存续的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
T日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
T + n日：	指自T日起第n个工作日，不包含T日
申购：	指在基金合同生效后，投资者申请购买本基金基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为
元：	人民币元
基金账户：	指注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记人办理登记过户的基金份额余额及其变动情况的账户
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、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债总值后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
流动性受限资产：	指由于法律法规、监管、基金合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持

	证券，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
不可抗力：	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或无人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等
基金产品资料概要	指《融通新蓝筹证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）

### 第三节 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司

住所：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期：2001年5月22日

法定代表人：高峰

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14、15层

电话：（0755）26947517

联系人：赖亮亮

注册资本：12500万元人民币

股权结构：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、现任董事情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，经济学博士，民进会员，注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计，吉林大学教师、讲师、教授。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士后、执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，法学博士，现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今，任公司独立董事。

董事王利先生，工学学士，现任新时代证券股份有限公司总经理助理，兼任投资银行业务内核负责人及场外市场部行政负责人。历任中石化齐鲁分公司财务部会计，上海远东证券有限公司总经理助理兼稽核部总经理，新时代证券股份有限公司合规管理部总经理、法律事



务部总经理、公司内核负责人、场外市场部负责人、投行业务条线负责人。2018年2月至今，任公司董事。

董事律磊先生，法学硕士，现任明天控股有限公司人力资源部总经理。历任原国务院法制办公室秘书行政司副主任科员、主任科员、副处长、调研员等。2019年8月至今，任公司董事。

董事王裕闵先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司资深常务投资顾问，兼任ARK Investment Management GP LLC 董事会列席代表。历任 M&T Bank 分析员，FGIC（GE Capital 通用资本的子公司）交易员，General Reinsurance 基金经理，CGA Investment Management 高级基金经理，Structured Credit Partners LLC 联合创始人兼首席投资官，Wachovia Corporation 董事总经理兼全球结构信贷产品主管、董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主管，宏利资产管理（Manulife Asset Management）香港亚洲固定收益产品主管，日兴资产管理有限公司首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司副总裁、全球投资主管兼首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司联合全球投资主管兼首席投资官。2018年3月至今，任公司董事。

董事 Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司（日本东京）经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今，任公司董事。

董事张帆先生，工商管理硕士，清华大学 EMBA。历任新时代证券经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月至今，任公司董事。

## 2、现任监事情况

监事刘宇先生，金融学硕士、计算机科学硕士，现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月至今，任公司监事。

## 3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月至今，任公司董事长。

总经理张帆先生，工商管理硕士，清华大学 EMBA。历任新时代证券经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月至今，任公司总经理。

常务副总经理 Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士。历任富达投资公司（美国波

士顿）分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2011年3月至今，任公司常务副总经理。

督察长涂卫东先生，法学硕士。曾在原国务院法制办公室财金司、中国证监会法律部和基金监管部工作，曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今，任公司督察长。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理情况

张延闽先生，哈尔滨工业大学工学硕士，9年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2010年2月加入融通基金管理有限公司，历任行业研究员、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2015年1月16日至2019年4月12日），现任权益投资部总经理、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年8月12日起至今）、融通新蓝筹证券投资基金基金经理（2017年2月17日起至今）、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018年2月11日起至今）、融通研究优选混合型证券投资基金基金经理（2018年12月5日起至今）。

##### （2）历任基金经理情况

自2002年9月13日至2004年7月20日，由詹凌蔚先生担任本基金的基金经理。

自2004年7月21日起至2007年9月27日，由刘模林先生担任本基金的基金经理。

自2007年9月28日起至2009年7月22日，由刘模林先生与戴春平先生共同担任本基金的基金经理。

自2009年7月23日起至2009年8月25日，由刘模林先生担任本基金的基金经理。

自2009年8月26日起至2010年4月22日，由刘模林先生和张敏先生共同担任本基金的基金经理。

自2010年4月23日起至2011年3月23日，由刘模林先生、张敏先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2011年3月24日起至2011年4月5日，由刘模林先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2011年4月6日起至2012年7月24日，由吴巍先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2012年7月25日起至2014年10月29日，由吴巍先生、汪忠远先生和姚昆先生共同担任本基金的基金经理。

自2014年10月30日起至2015年8月28日，由姚昆先生担任本基金的基金经理。

自2015年8月29日起至2017年2月16日，由何龙先生担任本基金的基金经理。

自2017年2月17日起至2018年8月24日，由何龙先生和张延闽先生共同担任本基金的基金经理。

自2018年8月25日起至今，由张延闽先生担任本基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

公司权益公募基金投资决策委员会成员：权益投资总监、基金经理邹曦先生，权益投资部总经理、基金经理张延闽先生，研究部总经理、基金经理付伟琦先生，组合投资部总监、基金经理余志勇先生。

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，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律、法规和证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，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）不公平地对待管理的不同基金财产；

- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金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) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (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) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### **（五）基金管理人关于禁止性行为的承诺**

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，但法律法规和监管部门另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

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主承销的证券；

7、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

对上述事项，法律法规另有规定时从其规定。

#### **（六）基金经理承诺**

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

2、不利用职务之便为自己、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机构或个人进行证券交易。

#### **（七）基金管理人的内部控制制度**

##### **1、内部控制制度概述**

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

##### **2、内部控制原则**

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

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，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，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。

### 3、主要内部控制制度

#### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

#### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

#### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责组织指导公司监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，并经全体独立董事同意。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司任何会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长应当定期或不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflow。

监察稽核制度包括内部监察稽核管理办法、内部监察稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规、规章和公司内控制度的情况，检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

#### 4、基金管理人关于内部控制制度的声明

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 第四节 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，中国建设银行先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。中国建设银行同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管



运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和中国建设银行内有关管理规定，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。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释

或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构情况

##### （1）融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

邮政编码：518053

联系人：陈思辰

电话：（0755）26948034

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）26948088

##### （2）融通基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 84 号丰汇时代大厦东翼 5 层 502-507 房间

邮政编码：100032

联系人：柴玟

电话：（010）66190982

##### （3）融通基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 34 层 3405 号

邮政编码：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：（021）38424889

##### （4）融通基金管理有限公司网上直销

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

邮政编码：518053

联系人：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

#### 2、其他销售机构

##### （1）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

法定代表人：田国立

客服电话：95533

联系人：王琳

电话：（010）66275654

（2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

法定代表人：周慕冰

联系人：吴双

电话：（010）68298560

客服电话：95599

（3）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇（代）

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：（021）58781234

（4）招商银行股份有限公司

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：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

客服电话：95555

（5）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：汤征程

联系电话：（021）68475888

（6）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：郭明

电话：（010）66107909

网址：www.icbc.com.cn

（7） 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

联系人：顾林

电话：（010）66594956

客户服务电话：95566

（8） 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：董云巍

客服电话：95568

（9） 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

联系人：王曦

电话：（010）66223584

（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8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

电话：（010）65557062

传真：（010）65550827

客户服务电话：95558

网址：www.citicbank.com

（11） 中国光大银行股份有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：李晓鹏

联系人：李伟

电话：（010）68098778

（12）平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：（0755）25859591

传真：（0755）25879453

客户服务电话：95511-3

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

（13）华夏银行股份有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客服热线：95577

网址：<http://www.hxb.com.cn/index.shtml>

（14）渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022-58316666

客服电话：95541

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

（15）中国邮政储蓄银行股份有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：李国华

客服热线：95580

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

（16）恒丰银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号  
办公地址：上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦  
法定代表人：陈颖  
电话：021-63890179  
传真：021-63890209  
联系人：李胜贤  
客服热线：95395  
公司网站：[www.hfbank.com.cn](http://www.hfbank.com.cn)

（17）宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 24 层  
法定代表人：陆华裕  
客户服务电话：95574  
联系人：邱艇  
电话：0574-87050397

（18）包商银行股份有限公司（仅销售前端）

注册地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号  
办公地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号  
法定代表人：李镇西  
联系人：周雪晴  
电话：010-64816038  
客户服务电话：95352  
网址：[www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

（19）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号  
办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号  
法定代表人：王兰凤  
传真：0512-69868370  
联系人：葛晓亮  
电话：0512-69868519  
客服热线：96067



网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)。

（20）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：(021)58870011

（21）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

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

（22）北京虹点基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：胡伟

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：葛亮

客服热线：400-618-0707

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

（23）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座9楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

电话：(021)54509998

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

（24）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 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：010-85657353

传真：010-65884788

联系人：陈慧慧

客服热线：4009200022

公司网站：<http://licaike.hexun.com/>

（25）中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区麦子店西街 3 号新恒基大厦 15 层

法定代表人：姜新

电话：010-65807865

传真：010-65807864

联系人：郭爱丽

客服热线：010-59539901

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

（26）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

联系人：李静如

客服热线：4008188000

公司网站：<http://www.myfund.com/>

（27）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法人代表：罗细安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

(28) 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心主楼 4F（07）单元

法定代表人：曾革

联系人：鄢萌莎

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

(29) 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：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：董一锋

客服热线：4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(30) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号 1 幢 A2008 室

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

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

(31) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

电话：010-65215588

传真：010-85712195

联系人：李雯

客服热线：400-021-8850

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

(32) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：赵森

电话：010-59539864

传真：010-59539806

客户服务电话：95162

(33) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108

办公地址：北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108

法定代表人：赵荣春

电话：010-59422766

联系人：姚付景

客服热线：400-893-6885

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

(34) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客服热线：400-9180808

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

(35) 上海汇付基金销售有限公司

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层

法定代表人：金佶

电话：021-34013996

联系人：甄宝林

客服热线：021-34013999

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

(36) 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：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层

法定代表人：李兴春

电话：021-60195121

传真：021-61101630

联系人：郭丹妮

客服热线：95733

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

(37) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

联系人：刘勇

客服热线：0755-83999907

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

(38) 上海陆金所基金销售有限公司（仅销售前端）

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电 话：021-20665952

客户服务电话： 4008219031

公司网站：www.lufunds.com

（39）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇廊公路 7650 号 205 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 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：贾雅楠

电话：(021)38509630

（40）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：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人： 杨懿

电话：010-83363101

联系人：文雯

公司网站：<http://8.jrj.com.cn/>

（41）珠海盈米基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

客服热线：020-89629066

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

（42）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

联系人：林爽

联系电话：（010）66045608

客服电话：（010）66045678

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

（43）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：龚江江

客服热线：4006-788-887

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

（44）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人：张跃伟

电话：021-2069-1831

传真：021-2069-1861

联系人：王敏

客服热线：4008202899

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

（45）北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村e世界A座1108室

法人代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

客户服务电话：010-56251471

传真：010-62680827

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

（46）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

办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服热线：400-111-0889

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

（47）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：黄祎

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

联系人：徐亚丹

客服热线：400-799-1888

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

（48）上海中正达广基金销售有限公司

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

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客服热线：400-6767-523

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

（49）大泰金石基金销售有限公司

办公地址：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

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇



电话：021-20324153

网址：<http://www.dtfunds.co>

（50）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：0755-8946 0500

传真：0755-2167 4453

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

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

（51）北京肯特瑞基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济技术开发区科创十一街18号京东集团总部A做17层

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

客服热线：95518

公司网站：[jr.jd.com](http://jr.jd.com)

（52）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE

法定代表人：高锋

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

联系人：廖苑兰

客服热线：4008048688

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

（53）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层

法定代表人：沈丹义

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客户服务电话：400-101-9301

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

（54）大河财富基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号

办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

电话：0851-88405606

传真：0851-88405599

客户服务电话：0851-88235678

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

（55）万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

电话：010-59013828

传真：010-59013707

联系人：王芳芳

客服热线：010-59013842

公司网站：<http://www.wanjiawealth.com/>

（56）北京植信基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（57）深圳市锦安基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局  
综合办公楼 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市福田区新世界中心 4 楼

法定代表人：李学东

电话：0755-84669000

传真：0755-23982839

联系人：夏用功

客服热线：400-0719-888

公司网站：<http://www.annfund.com/>

（58）上海联泰基金销售有限公司

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：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

邮编：200335

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

（59）上海挖财基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

电话： 021-50810687

传真： 021-58300279

联系人：孙琦

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（60）上海凯石财富基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（61）中证金牛（北京）投资咨询有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336539

传真：010-59336500

联系人：沈晨

客服热线：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（62）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：侯芳芳

客服热线：400-159-9288

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

（63）方德保险代理有限公司（原金惠家保险代理有限公司）

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

法定代表人：林柏均

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：胡明哲

客服热线：010-64068617

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

（64）上海华夏财富投资管理有限公司（仅销售前端）

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

电话：010-88066184

传真：010-63136184

联系人：张静怡

客服热线：400-817-5666

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

（65）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇78号

办公地址：南京市玄武区天时国贸大厦11层E座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：025-56663409

客服热线：025-66046166

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

（66）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人： 贲惠琴

电话： 021-50206003

传真： 021-50206001

联系人： 杨一新

客服热线： 021-50206003

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

（67）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

电话：025-66996699

传真：025-66996699

联系人：张云飞

客服热线：025-66996699

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

（68）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 e 世界 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

客服热线：010-56251471

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

（69）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

电话： 021-65370077

传真：021-55085991

联系人：许付漪

客服热线：400-820-5369

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

（70）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

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

（71）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工体北路甲2号群房2层22单元

办公地址：北京市朝阳区工体北路甲2号群房2层22单元

法定代表人：郑毓栋

电话：400-618-0707

传真：010-65951887

联系人：牛亚楠

客服热线：400-618-0707

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

（72）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027810

传真：0411-39027835

联系人：于秀

客服热线：4000899100

公司网站：www.yibaijin.com

（73）方德保险代理有限公司（原金惠家保险代理有限公司）

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

法定代表人：林柏均

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：胡明哲

客服热线：010-64068617

公司网站：www.fundsure.cn

（74）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

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

电话：（021）38676161

客服电话：4008888666

（75）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

电话：（010）85130236

客服电话：95587

（76）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：（0755）82130833

客服电话：95536

（77）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



法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：（0755）82960167

客服电话：4008888111、95565

（78）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：（027）68751860

客服电话：95579

（79）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

客服电话：4008601555

（80）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：（020）87555888-8333

客服电话：95575

（81）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

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：（010）66568292

客服电话：4008-888-888

（82）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服电话：4008895548

(83)东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22、23、25-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：（021）63325888

客服电话：95503

(84)山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：邓颖贇

联系电话：（0351）8686796

客服电话：95573

(85)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

(86)渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

(87)万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

法定代表人：罗钦城

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话：400-8888-133

(88)民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：(010)85252656

客户服务电话：4006198888

(89)长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16/17层

法定代表人：曹宏

联系人：李嘉禾

电话：(0755)83516289

客服电话：4006666888

(90)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

法定代表人：周健男

联系人：李芳芳

电话：(021)22169081

客服电话：95525

(91)平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：(0755)38631117

客服电话：95511-8

(92)华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

电话：（0551）65161675

客服电话：95318，4008096518

(93)国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街8号

法定代表人：姚志勇

联系人：袁丽萍

电话：（0510）82831662

客服电话：95570

(94)金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼

法定代表人：王作义

联系人：张霞

电话：（0755）21516897

客服电话：4008888228

(95)国都证券股份有限公司

联系地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

联系人：刘河斌

联系电话：（010）84183389

电话：4008188118

(96)第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

联系人：王叔胤

电话：（010）63197785

客服电话：95358，4008881888

(97)东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

电话：（0431）85096517

客服电话：95360

(98)国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：（0791）86283080

客服电话：4008222111

(99)恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：（0471）4972343

客服电话：4001966188

(100)华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：陈牧原

联系人：刘宏波

电话：（0931）8490208

客服电话：96668

(101)兴业证券股份有限公司

联系地址：福州市湖东路268号证券大厦

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

客服电话：95562

(102)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001 95553

(103)新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：叶顺德

联络人：田芳芳

电话：（010）83561146

客服电话：95399

(104)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：王连志

联系人：刘志斌

联系电话：（0755）82558323

客服电话：4008001001

(105)西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街232号信托大厦16—17层

法定代表人：徐朝晖

联系人：刘莹

电话：（029）87406649

客服电话：95582

(106)方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层

法定代表人：施华

联系人：丁敏

联系电话：（0731）85832463

客服电话：95571

(107)国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：杨鹏军

电话：（0551）2207114

客服电话：95578

(108)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

电话：（021）68475888

客服电话：4008918918

(109)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

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：（0755）82492193

客服电话：95597

(110)信达证券股份有限公司

注册地址：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：张晓辰

联系电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

(111)申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：李梅

联系人：余敏

电话：（021）33389888

客服电话：95523 或 4008895523

(112)华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

客服电话：96326

(113) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

电话：010- 88321613

客服电话：4006-650-999

(114) 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

法定代表人：李琦

联系人：余敏

电话：010-88085858

客户服务电话：400-800-0562

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

(115) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

电话：010-85679888-6035

客服电话：4009101166

(116) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客服电话：4006-600109



(117) 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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：0755-82791065

客服热线：4009908826

(118) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：廖庆轩

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

(119) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：秦雨晴

电话：021-20315255

客户服务电话：95538

(120) 北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系人：许爽

客服电话：4008188866

(121) 中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：丁敏

电话：(0731) 85832463

客服电话：400-889-5618;

(122) 东海证券股份有限公司

注册地址：常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333910

客服电话：400-888-858

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站上更新。

## （二）注册登记机构

名称：融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

成立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：高峰

电话：0755-26948075

联系人：杜嘉

## （三）律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

法定代表人：闵齐双

联系人：崔卫群

经办律师：闵齐双 崔卫群

电话：075533382888（总机） 075533033936（直线） 13480989076

传真：075533033086

## （四）会计师事务所

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：薛竞、俞伟敏

## 第六节 基金的募集

本基金经中国证监会2002年7月25日证监基金字[2002]41号文核准募集。募集期为2002年8月15日至2002年9月6日。经安永华明会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，共募集2,218,864,742.31份基金份额，有效认购户数为46,806户。

## 第七节 基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

基金合同已于2002年9月13日生效。

### （二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人有权宣布本基金终止，并报中国证监会备案。法律、法规或证券监管部门另有规定的，从其规定。

## 第八节 基金份额的申购、赎回与转换

### （一）基金投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规及有关规定禁止购买者除外）和合格的境外机构投资者。

### （二）申购、赎回与转换的办理场所

1、本公司的直销机构和公司网站（详见本招募说明书第五节）。

2、本公司委托的销售机构的营业网点（详见本招募说明书第五节）。

本公司可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

### （三）申购、赎回与转换的开放日及时间

#### 1、申购、赎回与转换的办理时间

本基金为投资者办理申购、赎回与转换等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售机构约定。目前业务办理时间为上午 9:30 至 11:30，下午 13:00 至 15:00。基金管理人可以根据实际情况调整业务办理时间。

投资者在本招募说明书约定之外的日期和时间提出申购、赎回与转换申请的，其基金份额申购、赎回与转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格。

#### 2、申购开始日

基金合同生效后，开始接受申购的时间为2002年10月15日。

#### 3、赎回开始日

基金合同生效后，开始接受赎回的时间为2002年11月1日。

#### 4、转换开始日

本基金已于2006年11月21日及后续公告的相关日期起，开放通过本公司的直销机构及部分销售机构办理本基金与本基金管理人管理的其它基金之间的转换业务。具体详情请查看公司网站或相关公告。

### （四）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、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

- 3、在限制申购的情况下，申购费用按确认的申购金额所对应的申购费率计算。
- 4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间（目前为15:00）以前撤销。
- 5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可根据基金运作的实际情况更改上述原则，并最迟于新规则开始实施日前3个工作日在指定媒介上公告。

#### （五）基金转换的原则

1、基金转换的计算采用“未知价”原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金份额净值为基准进行计算。

2、采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请。

3、基金转换无基金份额持有时间限制。

4、基金转换收取适当的基金转换费和补差费。

5、基金转换转出的基金在申请日有权益，确认日开始无权益；基金转换转入的基金在申请日无权益，确认日开始记权益。

6、于2010年3月15日之前已转入的基金份额持有时间按其初始持有时间连续计算。根据中国证监会颁布的《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的要求，于2010年3月15日起转入的基金份额的持有时间自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

7、在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态。

8、在发生限制申购或巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。如果发生连续巨额赎回，基金转换不顺延。

9、由于前端费用和后端费用的费率结构差异较大，因此，基金转换只允许在缴纳前端认购（申购）费用的基金份额之间或者缴纳后端认购（申购）费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳后端认购（申购）费用的基金份额，或将缴纳后端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳前端认购（申购）费用的基金份额。

10、转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即份额注册日期在前的优先转出，份额注册日期在后的后转出；

11、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前3个工作日在指定媒介上公告。

#### （六）申购、赎回与转换的限制

1、投资者在销售网点和网上直销的每次最低申购金额为1元人民币（含申购费，定期定额申购每次最低金额为1元人民币）；在直销机构的直销柜台单笔最低申购金额为10万元人民币（含申购费）。

2、本基金每笔最低赎回份额、最低转换份额为1份，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回或转换出。投资者基金账户的最低持有份额为1份，在投资者的基金份额余额低于规定的最低持有份额时，基金管理人有权将其基金份额一次性全部赎回。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购最低金额或赎回与转换最低份额的限制，最迟在开始实施前3个工作日在指定媒介上公告。

### （七）申购、赎回与转换的程序

#### 1、申购、赎回与转换申请的提出

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回与转换的申请。

#### 2、申购、赎回与转换申请的确认

申请当日（T日）在规定时间内受理的申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或其办理业务的销售网点查询确认情况。

#### 3、申购与赎回的款项支付

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

投资者赎回申请确认后，赎回款项将在T+5日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。

### （八）本基金的申购费、赎回费与转换费

#### 1、申购费率

（1）本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

（2）本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的前端申购费率，同时区分普通客户申购和养老金客户通过直销机构直销柜台前端申购。

上述养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

#### 1) 全国社会保障基金；



- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

普通客户指除通过直销机构直销柜台申购的养老金客户以外的其他客户。

普通客户申购本基金前端基金份额的费率表如下：

申购金额（M）（单位：元）	前端申购费率
M < 100 万	1.50%
100 万 ≤ M < 500 万	0.90%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.30%
M ≥ 1000 万	单笔 1000 元

养老金客户通过直销机构直销柜台申购本基金前端基金份额的申购费为每笔 100 元。

(3) 本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

持有时间（T）	后端申购费率
T < 1 年	1.60%
1 年 ≤ T < 2 年	1.20%
2 年 ≤ T < 3 年	0.80%
3 年 ≤ T < 4 年	0.40%
T ≥ 4 年	0.00%

说明：上表中，1 年为 365 天。

## 2、赎回费率

本基金的赎回费率区分普通客户赎回和通过直销柜台赎回的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括：

- (1) 全国社会保障基金；
- (2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- (3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- (4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人届时将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，在招募说明书更新时对其进行更新。

普通客户指除通过直销柜台赎回的养老金客户以外的其他客户。

对于普通客户而言，对持续持有期限少于7日的基金份额持有人，本基金将收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期限不少于7日的基金份额持有人，赎回费率为0.5%，最低赎回费为5元，赎回费用由赎回人承担，赎回费的40%归基金财产。

对于养老金客户而言，对持续持有期限少于7日的基金份额持有人，本基金将收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日的基金份额持有人设置特定赎回费率，特定赎回费率为原赎回费率的40%，即特定赎回费100%计入基金财产。

### 3、转换费率

(1) 基金转换只允许在缴纳前端申购(认购)费用的基金份额之间或者缴纳后端申购(认购)费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳后端申购(认购)费用的基金份额，或将缴纳后端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳前端申购(认购)费用的基金份额。基金转换费用包括转换费和补差费。

(2) 转换费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

(3) 补差费：对于前端收费模式基金，转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时，补差费为0；转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时，按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费。对于后端收费模式基金，补差费为0。

(4) 基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算，累计不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额。

(5) 基金转换费由转换申请人承担，归转出基金基金财产部分按照转出基金赎回费归入基金财产部分收取，其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费由转换申请人承担，作为相关的手续费。

4、基金管理人可以调整申购、赎回与转换费率，最新的申购、赎回与转换费率在招募说明书（更新）中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前3个工作日在指定媒介公告。

### **(九) 申购份数、赎回金额与转入份数的计算方式**

#### 1、申购份数的计算

净申购金额以四舍五入的方法保留小数点后两位，余额归基金财产；基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

#### (1) 前端收费模式

如果投资者选择缴纳前端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

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

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

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

(2) 如果投资者选择缴纳后端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购份数} = \text{申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

例一：

1) 假定 T 日的基金份额净值为 1.2000 元，某投资者（普通客户）申购四笔，申购金额分别为 5,000 元、100 万元、500 万元和 1,000 万元。

如果该投资者选择缴纳前端申购费，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额（元，A）	5,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00	10,000,000.00
前端申购费率（B）	1.50%	0.90%	0.30%	固定费用
前端申购费用（元，C=A-D）	73.89	8,919.72	14,955.13	1,000.00
前端净申购金额（元， D=A/(1+B)）	4,926.11	991,080.28	4,985,044.87	9,999,000.00
前端收费模式 申购份数（份， E=D/1.2000）	4,105.09	825,900.23	4,154,204.06	8,332,500.00

如果该投资者选择缴纳后端申购费，则在申购时投资者不需缴纳任何费用，各笔申购获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额（元，A）	5,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00	10,000,000.00
后端收费模式申购份数 （份，F=A/1.2000）	4,166.67	833,333.33	4,166,666.67	8,333,333.33

2) 假定 T 日的基金份额净值为 1.2000 元，某养老金客户选择缴纳前端申购费并通过直销机构直销柜台申购 10 万元。则前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 100 = 99,900 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,900 / 1.2000 = 83,250 \text{ 份}$$

## 2、赎回金额的计算

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按四舍五入的方法计

算并扣除相应的费用。

赎回费以四舍五入的方法保留小数点后两位，余额归基金财产。

（1）前端收费模式

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例二：假定T日的基金份额净值为1.2000元，某投资者（非养老金客户）赎回10,000份，持有期限为7日以上，对应的赎回费率为0.50%，则：

赎回总额=10,000×1.2000元=12,000元

赎回费用=12,000×0.50%=60元

赎回金额=12,000-60=11,940元

例三：假定T日的基金份额净值为1.2000元，某养老金客户赎回10,000份，持有期限为7日以上，对应的赎回费率为0.20%，则：

赎回总额=10,000×1.2000元=12,000元

赎回费用=12,000×0.20%=24元

赎回金额=12,000-24=11,976元

（2）后端收费模式

赎回总金额=赎回份数×T日基金份额净值

后端申购费=赎回份数×最小值（申购日基金份额净值，赎回日基金份额净值）×对应的后端申购费率

赎回费=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-后端申购费-赎回费

例四：假如T日的基金份额净值为1.1000元，投资者有一笔金额为1万元的申购，投资者在第三年赎回该笔基金份额，如第三年赎回时基金份额净值为1.4000元，则投资者可获得赎回款12,583.63，投资收益率为26%；投资者在第四年赎回该笔基金份额，如第四年赎回时基金份额净值为1.6000元，则投资者可获得赎回款14,432.73，投资收益率为44%。

计算过程如下：

	第三年赎回	第四年赎回
申购金额（元，A）	10,000.00	10,000.00
后端申购份数（B=A/1.1000）	9,090.91	9,090.91
赎回总金额（C=B×单位净值）	12,727.27	14,545.46

后端申购费率 (D)	0.80%	0.40%
后端申购费 (E=MIN(A, C) × D)	80.00	40.00
赎回费 (F=C × 0.5%)	63.64	72.73
赎回金额 (G=C-E-F)	12,583.63	14,432.73
投资收益率	26%	44%

### 3、转入情况的计算

基金转换以转换申请日的基金份额净值为基础计算，具体计算公式为：

转换金额 = 转出份数 × T 日转出基金份额净值

转换费 = 转换金额 × 转换费率

补差费 = (转换金额 - 转换费) / (1 + 补差费率) × 补差费率

转入份数 = (转换金额 - 转换费 - 补差费) / T 日转入基金份额净值

基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

基金转换费由转换申请人承担，其中 25% 归转出基金基金财产（但对持续持有期少于 7 日的客户收取的赎回费全额计入基金财产），其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费用由转换申请人承担，作为相关的手续费。

例五：某投资者转换 1 万份基金 A 至融通新蓝筹混合基金，则转换情况如下：

基金 A 转换份额 10,000 份；

基金 A 转换申请日份额净值 (NAV) 1.20 元；

融通新蓝筹混合基金份额净值 (NAV) 1.00 元

假设基金 A 的转换费率 0.30%（等同于基金 A 赎回费率）；

假设新蓝筹混合基金应收取的补差费费率为 0.20%；

转换金额 = 10,000 × 1.20 = 12,000 元；

转换费 = 12,000 × 0.30% = 36 元；

补差费 = (12,000 - 36) / (1 + 0.20%) × 0.20% = 23.88 元

转入份数 = (12,000 - 36 - 23.88) / 1 = 11,940.12 份

注：由于各基金收费模式及费率不同，该例仅作参考。

### 4、转出情况的计算

基金转换以转换申请日的基金份额净值为基础计算，具体计算公式为：

转换金额 = 转出份数 × T 日转出基金份额净值

转换费 = 转换金额 × 转换费率

补差费 = (转换金额 - 转换费) / (1 + 补差费率) × 补差费率

转入基金 A 份数 = (转换金额 - 转换费 - 补差费) / T 日转入基金 A 份额净值

基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

基金转换费由转换申请人承担，其中 25% 归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

例六：某投资者将 1 万份融通新蓝筹混合基金转换至基金 A，则转换情况如下：

转出份额 10,000 份；

转出申请日份额净值 (NAV) 1.00 元；

基金 A 份额净值 (NAV) 1.20 元

假设融通新蓝筹混合基金的转换费率 0.50% (等同于融通新蓝筹混合基金赎回费率)；

假设基金 A 应收取的补差费费率为 0.10%；

转换金额 =  $10,000 \times 1.00 = 10,000$  元；

转换费 =  $10,000 \times 0.50\% = 50$  元；

补差费 =  $(10,000 - 50) / (1 + 0.10\%) \times 0.10\% = 9.94$  元

转入基金 A 份数 =  $(10,000 - 50 - 9.94) / 1.20 = 8,283.38$  份

注：由于各基金收费模式及费率不同，该例仅作参考。

#### 5、基金份额资产净值的计算

T 日基金份额资产净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日基金份额的余额数量

本基金份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### (十) 申购、赎回与转换的注册登记

投资者申购或转换基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。投资者赎回或转换基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

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，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介公告。

#### (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，即认为发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，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办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第二个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

本基金发生巨额赎回时，对于在开放日单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 30%以上的赎回申请，基金管理人可以延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应在 2 日内在指定媒介上刊登公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

## (十二) 拒绝或暂停申购、暂停赎回、拒绝或暂停转换的情形及处理

### 1、暂停或拒绝申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受投资者的申购申请：

(1) 基金管理人认为基金资产规模的扩大有可能对基金份额持有人的利益产生负面影响；

(2) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

(3) 由于不可抗力而导致基金无法正常工作；

(4) 证券交易所交易时间非正常停市；

(5) 法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批

准的其他暂停申购情形；

（6）基金管理人认为某笔申购申请可能影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请；

（7）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形时；

（8）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停申购的措施；

（9）当申购申请超过基金管理人设定的单一投资者单日或单笔申购金额上限、单日净申购比例上限、基金总规模的。

发生上述第（1）到第（5）、（8）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停公告。暂停期间，每月至少重复刊登暂停公告一次；暂停结束，基金重新开放申购时，基金管理人应在指定媒介上刊登基金重新开放申购公告及最近一个工作日基金份额净值。

对于销售机构已受理的申购申请或发生上述第（6）项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。发生上述第（7）项、第（9）项拒绝申购情形时，如果投资者的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。

## 2、暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易所交易时间非正常停市；

（3）因市场剧烈波动或其他原因出现连续巨额赎回，导致基金的现金支付出现困难，基金管理人可以暂停接受赎回申请；

（4）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停基金赎回或延缓支付赎回款项的措施；

（5）法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一时，基金管理人在当日向中国证监会报告。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，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请占已



接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续工作日予以兑付，并以该工作日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。

### 3、拒绝或暂停转换的情形及处理方式

当转出基金暂停赎回，或转入基金暂停申购时，基金管理人暂停接受基金投资者的转换申请；当转入基金拒绝申购时，基金管理人拒绝接受基金投资者的转换申请。

### 4、处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购、赎回和转换申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。暂停期间，基金管理人将每2周至少重复刊登暂停公告一次；暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人公告最近一个工作日基金份额净值。

#### **（十三）重新开放申购、赎回与转换的公告**

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在指定媒介上刊登基金重新开放申购、赎回或转换公告并公布最近一个工作日的基金份额净值。

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、赎回或转换时，基金管理人应提前1个工作日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

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；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前3个工作日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购、赎回或转换日公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### **（十四）非交易过户**

非交易过户是指由于司法强制执行、继承、捐赠等原因，本公司将某一基金账户的基金份额全部或部分直接划转至另一账户。司法强制执行是指司法机构依据生效法律文书将基金持有人持有的基金单位强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；继承是指基金持有人死亡，其持有的基金单位由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金单位捐赠给福利性质的基金会或社会团体。办理非交易过户必须提供相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起30个工作日内办理并按基金登记过户机构规定的标准收费。

### **（十五）转托管**

投资者可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该基金份额。投资者申购（认购）基金份额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。对于有效的基金转托管申请，基金单位将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构（网点）。

### **（十六）定期定额投资计划**

本基金已于 2002 年 11 月 27 日起，开放通过直销机构及部分销售机构办理本基金的定期定额投资计划。具体详情请查看公司网站或相关公告。

## 第九节 基金的投资

### （一）投资目标

本基金为“新蓝筹”资本增值型基金，主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金份额持有人获取长期稳定的投资收益。

### （二）投资方向

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。对“新蓝筹”企业的投资不少于股票资产的80%，同时将根据市场状况调整投资组合，把握投资机会，实现组合的进一步优化。

### （三）投资策略

在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%；权证投资比例浮动范围：0-3%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）留存比例浮动范围：不低于5%。

#### 1、资产配置

贯彻“自上而下”的投资策略，结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

#### 2、行业资产配置

在“新蓝筹”投资理念的指导下，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，确定股票资产在不同行业的投资比例。

#### 3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素；另一方面考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。

#### 4、股票选择

股票投资中将以“新蓝筹”资本增值型投资为主导，把企业的未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。致力于建立完善的数理统计体系，利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路，对市场运行特征进行跟踪，确保基金投资决策的科学性。同时重视对趋势

的把握，顺势而为，灵活操作。

“新蓝筹”企业的主要选择标准是：

（1）行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于6%或者GDP增长率；

（2）企业成长性较好，市场竞争能力强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

（3）企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高；财务管理能力较强，现金收支安排有序，资产盈利水平较高；

（4）企业财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

（5）企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位；

（6）企业管理层开拓进取，具备企业家素质，建立了科学的管理和组织架构。

## 5、权证投资策略

### （1）投资策略

根据权证作为衍生品品种本身的特性和作用，本基金在权证投资上主要运用以下投资策略：基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略；基于权证杠杆比率及Delta对冲比率分析基础上的权证替换投资策略；基于Black-Scholes等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

### （2）风险控制措施

1) 实行投资授权控制，确保权证投资的审慎性。

2) 实行投资流程控制，在充分研究的基础上参与权证的投资。权证投资必须有公司内部研究报告的支持，研究报告需包含权证标的证券的投资价值分析以及权证投资价值金融工程定量分析。

3) 公司监察稽核部依据相关管理规定对权证投资管理过程的合规性进行检查。

## 6、资产支持证券的投资策略及风险控制措施

### A、投资策略

在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于资产支持证券。

#### a、买入持有策略

可在与投资目标一致的前提下，买入并持有资产支持证券，以获取相应的利息收入。

b、利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期，预测资产支持证券收益率的变化趋势，从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

c、信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

d、相对价值策略

通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标，将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较，确定其是否具有相对价值，从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

B、风险控制措施

a、通过严格的投资流程控制投资风险，基金经理及有关人员必须严格执行公司投资授权制度。

b、在投资资产支持证券时，首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议，基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限，参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告，充分评估资产支持证券的风险收益特征，确定具体投资方案，在严格控制风险的前提下，谨慎进行投资。

c、基金交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

d、固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估，密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素，并在投资中进行相应操作，以规避信用风险的上升。

e、固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型，并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素，并评估其对资产支持证券持有期收益的影响，并进行相应的投资操作。

f、基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排，并考虑其对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

g、基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素，并评估其对资产支持证券投资价值的影响，并进行相应的投资决策。

h、将不断完善内部控制制度及相应技术手段，使基金相关操作以谨慎安全的方式进行，

确保基金及持有人利益得到保障。

i、将严格审查所投资资产支持证券的法律文件，确保各业务环节都有适当的法律保障。

#### （四）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%”。

#### （五）投资组合

投资组合的原则是追求收益性、流动性和安全性的有机结合。结合本基金的“新蓝筹”投资理念，本基金投资组合在保持基金资产流动性的条件下，将以获取资本增值为主。

本基金可投资于国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证，以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动，使得基金收益表现更加稳定；同时满足基金资产对流动性的要求。

本基金的投资组合必须符合以下规定：

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

（2）本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（5）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（7）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（8）本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

（9）本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有的同一权证不得超过该权证流通量的 10%。本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.50%；

（10）基金建仓期：自基金开始运作之日起，将在六个月内达到上述第（1）条、“投资

范围”中关于投资于新蓝筹企业的比例规定以及“投资策略”中关于股票投资比例浮动范围、债券投资比例浮动范围、现金留存比例浮动范围的有关规定；

（11）本基金可投资于资产支持证券：

A、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%。

B、投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的10%。

C、与基金管理人管理的其它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%。

D、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%。

E、因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第B项和第D项规定的比例，基金管理人将在10交易日内调整完毕。

F、投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。

G、基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

（12）遵守中国证监会规定的其它比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致投资组合超出上述比例不在限制之内，但基金管理人应在法规规定的期限内进行调整，以达到上述标准。

## （六）投资决策

### 1、决策依据

- （1）国家宏观经济环境；
- （2）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- （3）货币政策、利率走势；
- （4）地区及行业发展状况；
- （5）上市公司研究；
- （6）证券市场的走势。

### 2、决策程序

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

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

（2）基金经理根据研究部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，形成资产配置提案报投资决策委员会。

（3）投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

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

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

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

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

#### **（七）投资限制**

本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

#### **（八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法**

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；



4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

### （九）基金投资组合报告

本基金托管人中国建设银行根据基金合同规定，于2019年9月12日复核了本报告中的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2019年6月30日。本报告中所列财务数据已经审计。

#### 1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,568,198,938.43	72.92
	其中：股票	1,568,198,938.43	72.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	435,151,680.50	20.23
	其中：债券	435,151,680.50	20.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	136,671,771.55	6.35
8	其他资产	10,697,922.42	0.50
9	合计	2,150,720,312.90	100.00

#### 1.2 报告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）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	304,530,231.52	14.37
B	采矿业	363,431.25	0.02
C	制造业	526,367,344.71	24.84
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	275,116,777.84	12.98
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	222,941,009.68	10.52
J	金融业	150,205,291.97	7.09
K	房地产业	88,651,744.86	4.18
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	23,106.60	-
S	综合	-	-
	合计	1,568,198,938.43	74.01

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

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	600887	伊利股份	5,354,933	178,908,311.53	8.44
2	300059	东方财富	12,414,324	168,214,090.20	7.94
3	601933	永辉超市	16,333,792	166,768,016.32	7.87
4	601336	新华保险	2,728,901	150,171,422.03	7.09
5	300498	温氏股份	4,123,400	147,865,124.00	6.98
6	603960	克来机电	4,507,864	123,019,608.56	5.81
7	603883	老百姓	1,852,749	108,348,761.52	5.11
8	600742	一汽富维	9,297,772	99,207,227.24	4.68
9	002714	牧原股份	1,526,344	89,733,763.76	4.24
10	000031	大悦城	13,808,683	88,651,744.86	4.18

### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	94,695,000.00	4.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	335,536,891.00	15.84
	其中：政策性金融债	335,536,891.00	15.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,919,789.50	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	435,151,680.50	20.54

### 1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	108603	国开1804	1,282,000	128,276,920.00	6.05
2	180209	18国开09	600,000	60,018,000.00	2.83
3	199916	19贴现国债	600,000	59,688,000.00	2.82

		16			
4	140224	14 国开 24	500,000	50,270,000.00	2.37
5	190402	19 农发 02	400,000	39,932,000.00	1.88

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 1.7 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。

## 1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 1.9.1 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。

### 1.9.2 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。

## 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 1.10.2 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。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 1.11 投资组合报告附注

**1.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**1.11.2** 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,240,404.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,436,075.69
5	应收申购款	21,441.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,697,922.42

#### 1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十节 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效日为2002年9月13日，业绩表现截止日为2019年6月30日。本基金最近十年投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	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
2009年度	48.92%	1.58%	74.03%	1.50%	-25.11%	0.08%
2010年度	-1.25%	1.13%	-8.57%	1.19%	7.32%	-0.06%
2011年度	-23.04%	0.92%	-18.35%	0.98%	-4.69%	-0.06%
2012年度	4.44%	0.94%	7.06%	0.96%	-2.62%	-0.02%
2013年度	6.40%	1.06%	-4.97%	1.05%	11.37%	0.01%
2014年度	19.20%	1.01%	40.22%	0.92%	-21.02%	0.09%
2015年度	37.31%	2.16%	7.08%	1.87%	30.23%	0.29%
2016年度	-34.31%	1.53%	-8.55%	1.05%	-25.76%	0.48%
2017年度	16.17%	0.60%	15.04%	0.48%	1.13%	0.12%
2018年度	-17.33%	1.08%	-18.36%	1.00%	1.03%	0.08%
2019年上半年	13.48%	1.29%	20.09%	1.16%	-6.61%	0.13%

注：截至2009年12月31日，本基金的业绩比较基准为：国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%；2010年1月1日起2015年9月30日，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%，2015年10月1日起至今，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

## 第十一节 基金的财产

### （一）基金财产的构成

其构成主要有：

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

### （二）基金财产的账户

本基金以“融通新蓝筹证券投资基金”的名义开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （三）基金财产的保管及处分

1、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

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

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二节 基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金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。

### （二）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，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市股票的估值：

1）首次发行未上市的股票，按成本计量；

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

3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

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

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，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）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

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

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

(4) 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；

(5) 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；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人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；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

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

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、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。

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

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四) 估值程序



1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。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。

#### **(五) 估值错误的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

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、或登记结算机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过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人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，由差错责任方承担赔偿责任；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（“受损方”），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，如果因基金管理人过错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，如果因基金托管人过错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。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

（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出现过错的当事人进行追索，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）基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成10元人民币以上的损失。

（8）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，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，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如下：

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

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

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，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。

(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。

#### **(六) 暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它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、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 4、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商确认的；
- 5、中国证监会认定的其它情形。

#### **(七) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### **(八) 特殊情况的处理**

- 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(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十三节 基金收益的分配

### （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、持有期间产生的公允价值变动。

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照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

- 1、每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- 6、投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式，单个账户中不得对同一基金同时选取两种分红方式，投资者选择分红的默认方式为现金分红。分红再投资部分以权益登记日的基金份额净值为计算基准确定再投资份额；
- 7、基金收益分配比例按照有关法律法规的规定执行；
- 8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十四节 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、证券交易费用；
- 4、基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以基金资产净值的1.50%年费率计提。基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的2.50%的年费率计提。基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、上述“（一）基金费用的种类”中第3—7项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。最迟须于新的费率或收费方式实施前3个工作日在指定媒介上公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十五节 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金成立少于3个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金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各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认；

8、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

### （二）基金审计

1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金进行年度审计和分红审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

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。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六节 基金的信息披露

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。本基金信息披露事项必须在中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金合同是约定基金管理人、基金托管人、基金份额持有人权利、义务的法律文件。

基金托管协议是约定基金管理人和基金托管人权利、义务的法律文件。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

### （二）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报刊和网站上。

### （三）基金募集情况公告

基金管理人应当就基金份额发售的结果编制基金募集情况公告，并在募集期结束的次日登载于指定报刊和网站上。

### （四）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### （五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上,并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

#### **（六）基金净值信息**

《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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### **（七）基金份额申购、赎回价格**

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### **（八）定期报告**

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。



本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

### （九）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，并登载在指定报刊和指定网站上：

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及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，可能影响投资人对基金风险和未来表现的评估；
- 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### **（十）基金份额持有人大会决议**

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。

#### **（十一）澄清公告**

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，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、基金上市交易的证券交易所。

#### **（十二）清算报告**

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **（十三）中国证监会规定的其他信息**

#### **（十四）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，指定专门部门及高级管理人员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等法律法规规定。

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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

#### **（十五）信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

#### **（十六）本基金信息披露事项以法律法规规定及《基金合同》约定的内容为准。**

## 第十七节 基金的风险揭示

### （一）投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### 1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### 2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### 3) 利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### 4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### 5) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

#### 3、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个券原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

①拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估。

股票方面，本基金会选择市值较大、成交活跃的股票作为投资标的，在正常市场条件下具有较好的流动性；债券方面本基金将从债券久期、评级分布、行业集中度等方面入手，分散信用债持仓集中度，严格控制长久期、低评级信用债的投资比例。同时，本基金将对持有单一债券及同一发行人所发行债券占基金净资产比例进行控制，以使本基金投资组合保持良好流动性。

②巨额赎回情形下的流动性风险管理措施。

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，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办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第二个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

本基金发生巨额赎回时，对于在开放日单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人可以延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

（4）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应在2日内在指定媒介上刊登公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两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，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

③实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者潜在的影响。

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

#### 4、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 5、操作或技术风险

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

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

#### 6、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 7、特定的基金品种、特定的投资方法及基金所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 本基金在投资风格上属于平衡型基金产品，平衡型基金的产品虽然在风险调整后收益指标方面具有长期优势，但也存在其绝对收益率在某一阶段单边市场中逊色于某些单一风格基金的可能性。风险防范措施：基金管理人将发挥专业研究与理财优势，正确预期市场发展趋势，积极调整价值成长资产配置比例，将这一风险最小化。

（2）品种选择风险。融通新蓝筹证券投资基金的主要投资对象为处于企业成长期或成熟期早期的上市公司股票，由于中国经济发展正处在转型期，企业发展的宏观环境以及行业背景变化较大，因此处于这一特定阶段的上市公司的持续成长能力存在一定的不确定性，从而给基金投资的品种选择带来风险。风险防范措施：进一步完善数理统计体系，加强对上市公司基本面的研究，提高对公司未来发展战略、轨迹及可能的经营业绩预测的准确性。

（3）本基金对新蓝筹品种的定义及选择是建立在中国经济中长期持续稳定增长以及这种增长的不均衡性基础之上的，如果在未来某一特定阶段内，这一预期发生了不稳定偏差，可能造成入选新蓝筹股票的代表性不强、包容性不足的风险。风险防范措施：加强宏观经济研究与预测能力，积极调整基金投资策略。

8、本基金如投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，本基金并非必然投资于科创板股票。

投资科创板股票存在的风险主要包括：

#### （1）市场风险

科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板股票上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

#### （2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### （3）信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

#### （4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

#### （5）系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### （6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

#### 9、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

### （二）声明

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

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



## 第十八节 基金的终止与清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

- 1、存续期内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元人民币，基金管理人将宣布本基金终止；
- 2、基金经持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金清算小组

1、自基金终止之日起30个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金财产的保管、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。

### （三）基金清算程序

- 1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2、基金清算小组对基金财产进行清理和确认；
- 3、对基金财产进行估价；
- 4、对基金财产进行变现；
- 5、将基金清算结果报告中国证监会；
- 6、公布基金清算公告；

7、进行基金剩余财产的分配。

#### **（四）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。

#### **（五）基金剩余财产的分配**

基金清算后的全部剩余财产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **（六）基金清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **（七）基金清算账册及文件的保存**

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第十九节 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人的权利与义务

#### （一）基金管理人的权利

- 1、自本基金成立之日起，依法独立运用基金资产并独立决定其投资方向和投资策略；
- 2、依据基金合同的规定，获得基金管理人的管理费；
- 3、监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家法律法规，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 4、销售基金份额，获取认购（申购）费；
- 5、选择和更换销售代理人，并对其销售代理行为进行必要的监督；
- 6、依照有关法律法规，代表基金行使股东权利；
- 7、依据有关法律规定及本基金合同决定基金收益的分配方案；
- 8、在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，拒绝或暂停受理基金份额的申购和暂停受理基金份额的赎回申请；
- 9、法律法规及基金合同规定的其他权利。

#### （二）基金管理人的义务

- 1、遵守基金合同；
- 2、自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- 3、设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- 4、设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务；
- 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，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- 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资产；
- 7、接受基金托管人依法进行的监督；
- 8、负责基金登记过户。基金管理人应严格按照有关法律法规及本基金合同，办理或委托其他机构办理本基金的登记过户业务；
- 9、按规定计算并公告基金净值信息；

- 10、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；
- 11、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》、本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；
- 12、依据《基金合同》规定决定基金收益分配方案并向基金份额持有人分配基金收益；
- 13、按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
- 14、不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；
- 16、保存基金的会计账册、报表、记录15年以上；
- 17、确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；保证基金投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- 18、参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按照基金合同规定履行义务，基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；
- 22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 23、法律法规及基金合同规定的其他义务。

## **二、基金托管人的权利与义务**

### **（一）基金托管人的权利**

- 1、依法持有并保管基金资产；
- 2、依据基金合同的规定，获得基金托管费；
- 3、监督本基金的投资运作；
- 4、法律法规及基金合同规定的其他权利。

### **（二）基金托管人的义务**

- 1、遵守基金合同；
- 2、以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；

3、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

4、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在持有人名册保管、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

5、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资产；

6、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

7、以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

8、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

9、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

10、采用适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

11、采用适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额的认购、申购和赎回的方法符合基金合同等有关法律文件的规定；

12、采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等有关法律文件的规定；

13、按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国人民银行和中国证监会；

14、在定期报告内出具基金托管人意见，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；

15、负责保存基金份额持有人名册；

16、按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录15年以上；

17、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

18、依据基金管理人的指令或有关规定支付基金收益和赎回款项；

19、参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

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

22、基金管理人因过错造成基金资产损失时，按照有关的法律法规应为基金向基金管理人追偿；

23、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

24、法律、法规及基金合同规定的其他义务。

### **三、基金份额持有人的权利和义务**

（一）每份基金份额代表同等的权利和义务

（二）基金份额持有人权利

1、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；

2、取得基金收益；

3、监督基金经营情况，按有关规定获取基金业务及财务状况的资料；

4、申购、赎回或转换基金份额，并在规定的时间取得有效申请的款项或基金份额；

5、提请基金管理人或基金托管人履行基金合同规定应尽的义务；

6、取得基金清算的剩余资产；

7、因基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构的过错导致利益受到损害，有要求赔偿的权利；

8、知悉基金合同规定的有关信息披露内容；

9、法律、法规及基金合同规定的其他权利。

（三）基金份额持有人义务

1、遵守基金合同；

2、缴纳基金认购和申购款项，承担规定的费用；

3、承担基金亏损或者终止的有限责任；

4、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

5、法律、法规及基金合同规定的其他义务。

### **四、基金份额持有人大会**

（一）召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有10%以上基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- （6）《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规、本基金合同规定的其他事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- （4）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）对基金合同的变更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。

## （二）会议召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

3、代表基金份额10%以上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。

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。

### （三）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前30日在中国证监会指定媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开时间、地点、方式；
- （2）会议审议事项、议事程序、表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）代理投票委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名、电话；
- （6）其他注意事项。

2、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。

### （四）会议的召开方式

#### 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；
- （3）通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- （4）会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金份额持有人大会召开条件



（1）现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当不少于在代表权益登记日基金总份额的50%；

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

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在15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）通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

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

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

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交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。

如表决截止日前（含当日）未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在15个工作日后），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。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容仅限于本基金合同第八部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

（2）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；

（3）基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额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；

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

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

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

## 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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额10%以上的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或者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

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (六) 表决

- 1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。
- 2、基金份额持有人不得就未经公告的事项进行表决。
- 3、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2/3以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

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

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5、对于通讯开会方式的表决，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无效表决。

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。

#### （七）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选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人；

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管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。

#### （八）生效与公告

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。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两日内在中国证监会指定媒介公告。

## 五、基金合同解除和终止的事由、程序

### （一）基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

（1）存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，基金管理人有权宣布本基金终止；

（2）基金经持有人大会表决终止的；

（3）因重大违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

（4）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；

（5）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；

（6）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

（7）中国证监会允许的其他情形。

2、本基金合同终止后，须按法律法规和本基金合同对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后本基金合同终止。

### （二）基金清算小组

1、自基金终止之日起30个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金财产的保管、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。

### （三）基金清算程序

1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金财产；

2、基金清算小组对基金财产进行清理和确认；

3、对基金财产进行估价；

- 4、对基金财产进行变现；
- 5、将基金清算结果报告中国证监会；
- 6、公布基金清算公告；
- 7、进行基金剩余财产的分配。

#### （四）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。

#### （五）基金剩余财产的分配

基金清算后的全部剩余财产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （七）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### 六、争议解决方式

本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，可向有管辖权的人民法院起诉，也可根据事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

### 七、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

（一）本基金合同经基金发起人、基金管理人与基金托管人三方盖章、三方法定代表人或其授权代理人签字并经中国证监会批准后生效。基金合同的有效期限自生效之日起至本基金清算结束报中国证监会批准并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对本基金合同当事人具有同等法律约束力。

（三）本基金合同正本一式十份，其中上报中国证监会和中国人民银行各两份，基金发起人、基金管理人和基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

（四）本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 第二十章 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

法定代表人：高峰

成立时间：2001年5月22日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2001]8号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12500万元人民币

存续期间：50年

经营范围：发起设立基金；基金管理业务

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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；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；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据《基金法》、基金合同和其他有关规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产核算、基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配以及基金份额认购、申购、赎回和价格计算等行为的合法性、合规性等定期进行监督和核查。

2、基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式给托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

3、基金托管人发现基金管理人有关与《基金法》或其他相关法律、法规、基金合同和本协议禁止行为规定的重大违规行为时，应立即报告中国证监会，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。

### （二）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、根据《基金法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否妥善保管基金的全部资产、是否按时进行赎回资金的转出、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入指定的账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

2、基金管理人可对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产等，基金管理人应以书面方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。

3、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同和其他有关证券法规的规定，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即时核对并以书面形式给基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。

基金管理人发现基金托管人有与《基金法》或其他相关法律、法规、基金合同和本协议禁止行为规定的重大违规行为时，应立即报告中国证监会，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。

（三）基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或托管人无正当理由，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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

**三、基金财产的保管**

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金托管人依法持有并安全保管基金的全部财产。
- 2、基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的财产。托管人为基金设立独立的账户，本基金财产与托管人的其他财产及其他基金的财产实行严格的分账管理。
- 3、基金托管人应安全保管基金的全部财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（二）基金份额发售期间及成立时募集资金的验资

基金份额发售期间的资金应存于在基金托管人处开立的银行临时存款专用账户，该账户由基金管理人管理。

基金份额发售期满，由管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具验资报告应由参加验资的2名以上中国注册会计师签字有效。

基金成立后，基金管理人应将募集的全部资金存入基金托管人以基金名义开立的银行账户中。

（三）基金银行账户的开设和管理

- 1、基金的银行账户的开设和管理由基金托管人负责。
- 2、基金托管人以基金的名义在其营业机构开设一个基本账户和多个基金清算专用账户，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设备付金账户，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金的银行账户进行。

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



4、基金银行账户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

（四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1、基金托管人以本基金的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司和中央国债登记结算公司开设证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券资金清算；在中央国债登记结算公司开立债券账户，用于国债的交易和清算。中央国债登记结算公司及基金托管人和基金管理人签定三方国债回购主协议。

4、资金账户管理与使用由托管人负责。

5、基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理由基金管理人负责。

（五）基金同业拆借市场交易账户和国债托管账户的开设和管理

1、基金成立后，经中国证监会和中国人民银行批准，可申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人负责以基金名义在中央国债登记结算有限公司开设国债托管账户。

2、同业拆借市场交易账户和国债托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签定协议，进行使用和管理。

（六）其他账户的开设和管理

其他账户可以根据基金合同，经有关部门批准后，由基金托管人负责以基金名义开立。新账户按有关规则使用并管理。

（七）基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人以基金名义存入中央国债登记结算公司、中国证券登记结算有限责任公司或其他的代保管库中。保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同，由基金管理人以基金的名义签署，合同原件由基金托管人保管。

#### 四、基金资产净值计算与复核

（一）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

基金单位资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金单位总数后的价值。

估值程序和方法按照有关国家法律法规执行。

（二）复核程序

基金管理人每日对基金资产进行估值后，将估值结果发送给基金托管人，基金托管人按基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册由基金托管人按照中国证监会的有关规定，向融通基金管理有限公司的注册登记机构取得，安全保管，并向中国证监会报送。

## 六、争议解决方式

因本协议产生的争议，双方当事人应尽量通过协商、调节途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，可向有管辖权的人民法院起诉，也可以在本托管协议的签订地的仲裁机构通过仲裁方式解决。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和托管人职责，各自继续勤勉、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。

## 七、托管协议的修改与终止

（一）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。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、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其基金管理权；
- 4、发生《基金法》规定的基金终止事项。

## 第二十一节 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，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、 客户服务中心电话服务

持有人拨打基金管理人客服热线 400-883-8088（国内免长途话费）、0755-26948088 可享受如下服务：

A、自助语音服务：提供 7×24 小时电话自助语音服务，可进行账户查询、基金净值、信息定制等自助服务。

B、人工坐席服务：提供工作日人工坐席服务（法定节假日除外）。持有人可以通过该热线获得业务咨询、账户查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

### 二、 综合对账单服务

基金管理人为基金份额持有人提供综合对账单服务，服务形式包括网站自助查询、电子邮件账单、手机短信账单、客服热线查询、纸质对账单邮寄等。其中，纸质对账单邮寄仅限给已定制纸质对账单的持有人邮寄。

### 三、 网站自助服务

基金管理人网站（[www.rtfund.com](http://www.rtfund.com)）为持有人提供基金账户及交易情况查询、资料修改、手机短信和电子邮件信息定制等自助服务，提供公司公告、热点问答、市场评述等资讯服务。同时，网站还设有电子邮箱服务（客户服务邮箱：[service@mail.rtfund.com](mailto:service@mail.rtfund.com)）。

### 四、 网上交易服务

基金管理人提供开放式基金网上直销服务。投资者通过基金管理人网站 [www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 可以办理基金认购、申购、赎回、转换、撤单、基金定投、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易情况查询、积分查询和账户信息查询等各类业务。

### 五、 客户投诉建议受理服务

持有人可以通过基金管理人客服热线、网站、电子邮件及信函等渠道进行投诉或提出建议。对于工作日受理的投诉，原则上当日答复，当日未能答复的，我们也会在当日将处理进展情况及时告知持有人。

### 六、 联系方式

1、融通基金管理有限公司客户服务热线：

400-883-8088（国内免长途电话费）、0755-26948088

2、融通基金管理有限公司互联网站

公司网址：<http://www.rtfund.com>

电子信箱：[service@mail.rtfund.com](mailto:service@mail.rtfund.com)

3、客户服务传真：0755-26948079

4、邮寄地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13楼融通基金管理有限公司客户服务中心（邮编：518053）。

## 第二十二节 其他应披露的事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通关于旗下部分开放式基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019-3-25
2	融通关于旗下部分开放式基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-3-25
3	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-3-30
4	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-3-30
5	融通基金管理有限公司关于新增东海证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-4-8
6	融通关于旗下部分开放式基金参加北京植信基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-4-19
7	融通关于旗下部分开放式基金参加上海长量基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-4-26
8	融通关于旗下部分开放式基金参加方德保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-5-15
9	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿保	证券时报、管理人网站	2019-5-15

	险股份有限公司为销售机构的公告		
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-5-17
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2019-6-22
12	融通关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-6-28
13	融通基金管理有限公司关于新增联储证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-8-15
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019-8-16
15	融通基金关于通过大连网金基金销售有限公司开通定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-8-16
16	融通关于旗下部分开放式基金参加北京汇成基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019-8-29

### 第二十三节 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

## 第二十四节 备查文件

- （一）中国证监会核准融通新蓝筹证券投资基金设立的文件
- （二）《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》
- （三）《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》
- （四）《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值公告和其他临时公告等。

上述备查文件存放在本基金管理人、基金托管人办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。