

申万菱信盛利精选证券投资基金

《基金合同》

基金发起人：申万菱信基金管理有限公司

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

本合同条款未来如有修改，将在指定媒介公告，恕不另行书面通知

目 录

第一部分	前言和释义	1
第二部分	《基金合同》当事人及权利义务	7
第三部分	基金份额持有人大会	13
第四部分	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	19
第五部分	申万菱信盛利精选证券投资基金基本情况	21
第六部分	基金份额的认购	23
第七部分	基金的成立	25
第八部分	基金的申购与赎回	26
第九部分	基金资产的托管	36
第十部分	基金认购、申购、赎回业务代理协议	36
第十一部分	基金注册登记业务	37
第十二部分	基金的投资	39
第十三部分	基金的资产	45
第十四部分	基金资产估值	47
第十五部分	基金费用与税收	52
第十六部分	基金的收益与分配	54
第十八部分	基金的信息披露	57
第二十部分	业务规则	63
第二十一部分	违约责任	63
第二十二部分	争议的处理和适用的法律	64
第二十三部分	《基金合同》的效力	64
第二十四部分	《基金合同》的修改和终止	66
第二十五部分	其它事项	67

第一部分 前言和释义

前 言

为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范申万菱信盛利精选证券投资基金运作，依照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”、或“《基金合同》”）。

《基金合同》的当事人包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金发起人、基金管理人和基金托管人自《基金合同》签定并生效之日起成为《基金合同》的当事人。基金投资者自取得依《基金合同》所发行的基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受。《基金合同》的当事人按照法律法规和《基金合同》的规定享有权利，同时需承担相应的义务。

申万菱信盛利精选证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由基金发起人按照法律法规和《基金合同》的规定发起设立，经中国证监会批准。该批准并不表明中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，亦不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。

基金管理人保证将按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

基金发起人、基金管理人和基金托管人在《基金合同》之外披露的涉及本基金的信息，其内容涉及界定《基金合同》当事人之间权利义务关系的，以《基金合同》的规定为准。

自2004年6月1日起，《基金合同》应当适用《中华人民共和国证券投资基金法》之规定，若《基金合同》的内容存在与该法不一致之处，应当以该法的规定为准，《基金合同》

相应内容应当被视为自动按照该法的规定作出了相应的修改和调整。届时如果该法或其他法律法规要求《基金合同》进行变更或调整并进行公告的，应当按照该等规定进行公告。

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%的情形除外。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

释 义

《基金合同》中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本合同、《基金合同》：	指《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
中国：	指中华人民共和国(不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规：	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
元：	指中国法定货币人民币元
基金或本基金：	指依据《基金合同》所设立的申万菱信盛利精选证券投资基金
招募说明书：	指《申万菱信盛利精选证券投资基金招募说明书》及其更新，一份公开披露本基金设立、管理人及托管人、销售机构及有关中介机构、基金认购安排、基金成立、基金日常申购及赎回、基金非交易过户、基金管理、管理人内部控制制度、基金份额持有人权利义务及基金份额持有人大会、基金投资、基金费用及税收、基金资产及计价、基金收益及分配、基金会计及审计、基金信息披露制度、基金终止及清算、投资于基金的风险提示等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件
发行公告：	指《申万菱信盛利精选证券投资基金发行公告》
基金产品资料概要：	指《申万菱信盛利精选证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
业务规则：	指《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构：	指中国银行业监督管理委员会或中国人民银行(视情况)
基金管理人：	指申万菱信基金管理有限公司
基金发起人：	指申万菱信基金管理有限公司
基金托管人：	指中国工商银行
基金销售代理人：	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构：	指基金管理人及基金销售代理人

基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点
基金注册与过户登记人:	指申万菱信基金管理有限公司或其委托的其它符合条件的机构
《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法律主体
个人投资者:	指年满 18 周岁的合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证、武警证、护照的中国居民
机构投资者:	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
合格境外机构投资者:	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
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总称
基金成立日:	指自招募说明书公告之日起 3 个月内, 在基金净认购额超过人民币 2 亿元, 且认购户数达到或超过 100 户的条件下, 基金发起人可以依据有关法律法规和基金实际发行情况决定停止基金认购, 并宣告基金成立的日期
设立募集期:	指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段, 最长不超过 3 个月
基金存续期:	指基金成立后合法存续的不定期之期间
日/天:	指公历日
月:	指公历月
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
T 日:	指日常申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日:	指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)
认购:	指本基金在设立募集期内投资者购买本基金份额的行为
日常申购:	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续, 向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金成立后不超过 30 个工作日的时间开始办理
日常赎回:	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续, 向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金成立后不超过 30 个工作日的时间开始办理
基金转换:	指投资者将其所持有的本基金管理人管理的任一开放式基金向本基金管理人提出申请将其原有基金 (转出基金) 的全部或部分基金份额转换为本基金管理人管理的任何其他开放式基金

	(转入基金)的基金份额的行为
销售服务费:	指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用
基金份额分类:	本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时,收取申购费用,并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;不收取申购费用,但从本类别基金财产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码,并分别计算并公布基金份额净值
基金收益:	指基金投资所得债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
基金账户:	指基金注册与过户登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证
基金资产总值:	指基金所购买各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值:	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金资产计价:	指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程
流动性受限资产:	指由于法律法规、监管、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
摆动定价机制:	指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金申购赎回价格的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
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:	指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金发起人、基金托管人、基金管理人签署之日后发生的,使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府

征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

第二部分 《基金合同》当事人及权利义务

一、基金发起人

(一) 基金发起人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：陈晓升

成立时间：2004年1月15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[2003]144号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：持续经营

(二) 基金发起人的权利与义务

1、 基金发起人的权利

- (1) 申请设立基金；
- (2) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、 基金发起人的义务

- (1) 公告招募说明书和发行公告；
- (2) 遵守《基金合同》；
- (3) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人利益的活动；
- (4) 基金不能成立时及时退还所募集资金本息和承担发行费用；
- (5) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

二、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：陈晓升

成立时间：2004年1月15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[2003]144号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：持续经营

（二）基金管理人的权利与义务

1. 基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金资产；
- （2）依照《基金合同》获得基金认购和申购费用以及基金管理费；
- （3）销售基金份额；
- （4）作为基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （5）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （6）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （7）选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （8）依据本《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （9）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （10）在符合有关法律规法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （11）依照法律规为基金的利益对被投资公司行使股东权利；
- （12）为基金的利益行使基金所投资的证券项下的权利；
- （13）以自身的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （14）法律规和《基金合同》规定的其它权利。

2. 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) 配备足够的专业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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托其它机构代理该项业务;
- (5) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务;
- (6) 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;
- (7) 除依据法律法规和《基金合同》及其它有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金资产;
- (8) 接受基金托管人的依法监督;
- (9) 按规定计算并公告基金净值信息及各类基金份额净值;
- (10) 严格按照法律法规和《基金合同》的规定,履行信息披露及报告义务;
- (11) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规和《基金合同》及其它有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- (12) 按《基金合同》规定向基金份额持有人分配基金收益;
- (13) 按照法律和本《基金合同》的规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- (14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- (15) 依据法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会;
- (16) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照本《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时,承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;
- (21) 因基金估值错误给投资者造成损失的,应先由基金管理人承担,基金管理人对其应承担的责任,有权向过错人追偿;
- (22) 基金托管人因过错造成基金资产损失时,应为基金利益向基金托管人追偿;
- (23) 不得违反法律法规从事有损基金及其它基金当事人合法利益的活动;

(24) 对所管理的不同基金财产分别设账、进行基金会计核算，编制财务会计报表及基金报告；

(25) 法律、法规和《基金合同》规定的其它义务。

三、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：廖林

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和设立文号：1983 年 9 月 17 日国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

(1) 自本基金成立之日起，以法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金资产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 依据有关法规监督本基金的投资运作，如发现基金管理人违反本基金合同及国家法律法规行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户负责基金的债券及资金的清算；

(7) 提议召开基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

(1) 遵守《基金合同》；

- (2) 依法持有基金资产；
- (3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；
- (4) 设立专门的资产托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (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，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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (6) 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，不得为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (7) 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；
- (8) 保守基金商业秘密，除法律法规和《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额资产净值；
- (10) 采取适当、合理的措施，使开放式基金份额的认购、申购、赎回等事项符合《基金合同》等有关法律文件的规定；
- (11) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定；
- (12) 采取适当、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，并报中国证监会和银行监管机构；
- (14) 在定期报告内出具托管人意见，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) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (17) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的收益和赎回款项自基金托管专户划出；
- (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和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (20) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金管理人按照基金合同规定履行义务，基金管理人因过错造成基金资产损失

时，应代表基金向基金管理人追偿，但不承担连带责任；

(22) 不得违反法律法规从事任何有损本基金及其他《基金合同》当事人合法利益的活动；

(23) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

四、基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》发行的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为本《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章为必要条件。

1、基金份额持有人的权利

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 按《基金合同》的规定申购、赎回并在规定的时间取得有效申请的基金份额或款项；
- (3) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (4) 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；
- (5) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 因基金管理人、基金托管人、销售机构、基金注册与过户登记人的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；
- (8) 提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定应尽的义务；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及《基金合同》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《基金合同》当事人利益的活动；
- (5) 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；
- (6) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

第三部分 基金份额持有人大会

一、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合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。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（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应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或提高销售服务费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外）；
- 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》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

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、销售服务费率；
- 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它情形。

二、合同会议召集方式

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时，可向基金管理人提出书面提议。基金管理人自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，可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（含 10%）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，可向基金管理人提出书面提议。基金管理人自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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，应自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，可向基金托管人提出书面提议。基金托管人自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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，应自出具书面决定之日起六十日内召开；

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项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（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但至少提前三十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，召集人至少提前三十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，在指定媒介公告。

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必须出席；
- (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大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。

(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它代表,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。

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四部分“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% 或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，也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案（临时提案只适用于现场方式开会），临时提案最迟在大会召开日前 15 日提交召集人；召集人对于临时提案最迟在大会召开日前 10 日公告；

(4) 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。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行变更，应最迟在基金份额持有人大会召开日前 10 日公告。否则，会议的召开日期须顺延并保证至少与公告日期有 10 日的间隔期。

2、合同议事程序

(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（含 10%）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三分之二以上通过方可作出。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。对于基金份额持有人大会决定的事项，依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、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。

5、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采取分开审议、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，召集人自通过之日起五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。

对于基金份额持有人大会决议，按照法律法规的规定在指定媒介上进行公告。

第四部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

一、基金管理人和基金托管人的更换条件

(一) 基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，可更换基金管理人：

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

(二) 基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和银行监管机构批准，可更换基金托管人：

- 1、基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- 2、基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金份额持有人利益的；
- 3、代表 50%以上基金份额的基金份额持有人要求基金托管人退任的；
- 4、有关银行监管机构充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

(一) 基金管理人的更换程序

1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由代表 30%或以上基金份额的基金份额持有人提名；

2、决议：基金份额持有人大会被提名的基金管理人形成决议；

3、批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金管理人经中国证监会批准方可退任；

4、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上公告。新任基金管理人与原基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在指定媒介上公告；

5、基金名称变更：基金管理人更换后，如果申万菱信基金管理有限公司要求，应按要求替换或删除基金名称中“申万菱信”、“盛利”的字样。

（二）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或由代表 30%或以上基金份额的基金份额持有人提名；

2、决议：基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议；

3、批准：新任基金托管人经中国证监会和银行监管机构审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会和银行监管机构批准方可退任；

4、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金经理人和新任的基金托管人在基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上公告。

第五部分 申万菱信盛利精选证券投资基金基本情况

一、基金名称

申万菱信盛利精选证券投资基金

二、基金类型

契约型开放式

三、基金投资目标

本基金的投资目标是通过采用积极主动的分散化投资策略，依靠先进成熟的风险管理技术，运用领先的动态行业配置模型，努力创造长期领先于投资组合基准的稳定投资业绩，追求当期收益和长期增值的平衡，并实现中、长期资本增值为目标的最优化回报。

四、基金规模

本基金规模不设上限。

五、基金份额面值

基金份额面值为人民币 1.00 元。

六、基金存续期限

不定期

七、基金份额类别

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

在投资人申购时，收取申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取申购费用，但从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书中具体列示。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A

类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。

基金管理人可调整申购各类基金份额的最低金额限制及规则。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，或调整本基金的申购费率、变更收费方式或调低赎回费率等，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须在开始调整实施之日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

第六部分 基金份额的认购

本基金份额面值为人民币 1.00 元。

一、设立募集期

自招募说明书公告之日起至基金成立之日，但最长不得超过3个月，具体发行时间见发行公告。

二、认购对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资证券投资基金的除外)及合格境外机构投资者。

三、募集目标

本基金不设募集目标。

四、认购方式和销售渠道

本基金将通过基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点公开发售。任何与基金份额发行有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在设立募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤消。

五、认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用。基金认购费用不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。认购费用应在投资者认购基金份额时收取，认购费率最高不超过1.2%，具体费率按招募说明书的规定执行。

六、基金认购份额的计算

本基金的认购份额将依据投资者认购时所缴纳的认购金额(加计认购金额在认购期所产生的利息，以实际产生的金额为准)扣除认购费用后除以基金份额面值确定。基金份额面值为人民币1.00元。

认购份额计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

七、基金认购金额的限制

在设立募集期内，投资者可多次认购基金份额，首次认购的最低金额为人民币 1000 元，每次追加认购的最低金额为人民币 1000 元。

第七部分 基金的成立

一、基金的成立条件

本基金自招募说明书公告之日起3个月内，在基金净认购金额超过人民币2亿元，且认购户数达到或超过100户的条件下，基金发起人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金认购，并宣告基金成立；否则本基金不成立。本基金成立前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不得动用。认购款项在设立募集期内产生的利息将转化成基金份额归投资者所有。

二、基金不能成立时募集资金的处理方式

本基金不成立时，基金发起人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在设立募集期结束后30天内退还基金认购人。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金成立后的存续期内，有效基金份额持有人数量连续20个工作日达不到100人，或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，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。存续期内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，本基金应当终止，并报中国证监会备案。

第八部分 基金的申购与赎回

一、申购与赎回场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点进行。本基金管理人同时考虑，在适当的时候，投资者可通过基金管理人或者指定基金销售代理人进行电话、传真或网上等形式的申购与赎回。

二、申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自基金成立后不超过30个工作日的时间开始办理，基金管理人应在申购赎回开放日前3个工作日在指定媒介上刊登公告。

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、赎回时除外）。开放日的具体业务办理时间另行公告。

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，但此项调整不应投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日3个工作日前在指定媒介上刊登公告。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的各类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、本基金暂不采用摆动定价机制。待未来条件成熟，基金管理人在履行适当程序后，可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循届时有效的相关法律法规及监管部门、自律组织的规定；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响投资者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3个工作日前在指定媒介上刊登公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册与过户登记人在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它方式查询申购与赎回的成交情况。

3、申购和赎回的款项支付

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。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本《基金合同》的有关条款处理。

五、申购与赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资者首次购买的最低金额。具体规定请参见招募说明书；

2、基金管理人可以规定投资者每个交易账户的最低基金份额余额。具体规定请参见招募说明书；

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见招募说明书；

4、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告；

5、基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会

备案。

六、申购费用和赎回费用

1、本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示，C类基金份额不收取申购费。本基金A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。2、本基金A类基金份额在申购时收取申购费用。

3、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资人赎回本基金各类基金份额时收取，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产，对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，扣除注册登记费用后的余额归基金资产。

4、本基金A类基金份额的申购费率最高不超过3%，A类基金份额及C类基金份额的赎回费率最高不超过1.5%，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费。

5、本基金A类基金份额的申购费率、A类基金份额和C类基金份额的赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在《招募说明书》或相关公告中列示。基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内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3个工作日前在指定媒介公告。

七、申购份额与赎回金额的计算

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率和基金赎回费率。基金管理人可对部分基金投资人费用的减免不构成对其它投资人的同等义务。

1、本基金申购份额的计算：

(1) A类基金份额的申购份额计算

本基金A类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时交纳申购费）。申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

(2) C类基金份额的申购份额计算

申购本基金C类基金份额不收取申购费用，登记机构根据单次申购金额计算申购份额。

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

2、本基金赎回支付金额的计算：

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

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{T日该类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

3、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。本基金分为A类和C类基金份额，各类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后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二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

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二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

6、本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示，C类基金份额不收取申购费。本基金A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。本基金赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，对A类基金份额而言，对于持

续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产,对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费在扣除手续费后,余额不低于赎回费的25%归基金财产。对C类基金份额而言,对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费,将全额计入基金财产。

八、申购和赎回的注册与过户登记

投资者申购基金成功后,注册与过户登记人在T+1日为投资者登记权益并办理注册与过户登记手续,投资者自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后,注册与过户登记人在T+1日为投资者办理扣除权益的注册与过户登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述注册与过户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个工作日在指定媒介上刊登公告。

九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

1、除出现如下情形,基金管理人不得拒绝或暂停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) 证券交易所在交易时间非正常停市,导致无法计算当日的基金净值;
- (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) 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的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时;
- (5) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的;
- (6) 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,基金管理人应当暂停接受申购申请;
- (7) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形;
- (8) 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(1)、(2)、(3)、(6)、(7)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申购公告。当发生上述第(4)、(5)项情形时,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。

如果法律法规、监管要求调整导致上述第（4）项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述内容限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停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工作；
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；
- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

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；如暂时不能支付的，可支付部分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，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在指定媒介上公告。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。

3、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。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在指定媒介公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

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

当出现巨额赎回时，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。对于当日的赎回申请，应当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；投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤消。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，则投资者未能赎回部分自动延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将以下一个开放日的该类基金份额净值为准进行计算，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。若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

(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日内通过指定媒介刊登公告，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。

十一、其它暂停申购和赎回的情形及处理方式

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、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当立即在指定媒介上刊登暂停公告。

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，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或赎回公告并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。

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，基金管理人应提前一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各类基金份额净值。

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或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

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，投资者可以选择在本基金和申万菱信基金管理有限公司旗下其他基金(如有)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。

十四、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。

基金注册与过户登记人只受理继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、司法执行等情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是适格的个人投资者或机构投资者。

“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持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他社会团体；“遗赠”

指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；“分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；“国有资产无偿划转”指因管理体制变革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；“司法执行”是指根据生效法律文书，有履行义务的当事人（基金份额持有人）将其持有的基金份额依生效法律文书之规定自动过户给其他人，或法院依据生效法律文书将有履行义务的当事人（基金份额持有人）持有的基金份额强制划转给其他人。

投资者办理因继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产原因的非交易过户可到转出方的基金份额托管机构申请办理。投资者办理因国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构解散、企业破产、司法执行原因引起的非交易过户须到基金注册与过户登记人处办理。对于符合条件的非交易过户申请按《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定办理。

十五、基金的冻结

基金注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

十六、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。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金份额转入手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管转入手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金销售代理人的业务规则。

第九部分 基金资产的托管

为确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益，有关基金的托管事项应依照法律法规和《基金合同》的规定订立托管协议，用以明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金资产的保管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

第十部分 基金认购、申购、赎回业务代理协议

基金管理人委托其它机构代为办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的，应当与有关机构签订基金销售与服务代理协议。订立本代理协议的目的是为了明确基金销售代理人 and 基金管理人之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

第十一部分 基金注册登记业务

一、基金注册登记业务

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

二、基金注册登记业务办理机构

本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

三、注册登记机构的权利

注册登记机构的权利享有以下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 3、法律法规规定的其它权利。

四、注册登记机构的义务

注册登记机构的权利享有以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本《基金合同》规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录15年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其它情形除外；
- 5、按本《基金合同》及招募说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其它必要

的服务；

6、法律法规规定的其它义务。

第十二部分 基金的投资

一、 投资目标

本基金的投资目标是通过采用积极主动的分散化投资策略,依靠先进成熟的风险管理技术,运用领先的动态行业配置模型,努力创造长期领先于投资组合基准的稳定投资业绩,追求当期收益和长期增值的平衡,并实现中、长期资本增值为目标的最优化回报。

二、 投资范围和投资对象

根据法律法规的规定,本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票、存托凭证和债券、银行间债券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。在资产配置层面,本基金原则上可能的资产配置比例为:股票及存托凭证 50—75%,债券 20—40%,现金 5—10%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

具体投资对象将根据公司研究成果,以及流动性分析,以优质债券和具有一定成长性并且具投资价值的上市公司股票为主。

在本基金成立后六个月内,达到上述比例限制。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的,基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合,以符合上述限定。法律、法规另有规定时,从其规定。

三、 投资理念

构成本基金管理人投资哲学的两个关键要点为:

- (1) 寻找收益高于基准的证券投资,利用分散投资法降低整体风险;
- (2) 采用风险管理工具监控和准确跟踪投资组合风险。

四、 投资策略

本基金为以股票投资为主体的平衡型基金,采用主动投资管理模式。

本基金采取“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略。基金管理人引进外方股东法国菱信资产管理公司的投资管理经验及技能,根据国内市场的特征,将法国菱信资产管

理公司行之有效的投资管理方法及价值分析工具加以吸收和应用。这些投资管理工具包括内部开发的专用模型（包括股票估值模型、主动行业矩阵、债券估值模型）、以及惯用的成长价值平衡模型（PEG）、资产回报率模型（ROE、ROA）、自由现金流折现模型（DCF）及经济价值模型（EV/EBITDA）等。

本基金的投资过程中会有多次通过计量方法来选取投资目标，首先在建立基金备选库（股票池）的过程中利用较为明确的量化标准筛选比较有投资价值的公司。其次在构建投资组合时依照所选取投资风格对应的投资指标再次选取股票，以供投资参考，最后对于所投资的每一家上市公司，都需要通过管理素质量化评级表再次进行考核，以最终确立股票投资组合。

基金备选库（股票池）的建立

基金备选库的建立依据三项基本原则：

1. 流通市值或总市值居全体上市公司前 50%；
2. 过去 12 个月平均日成交金额高于市场平均数；
3. 过去三年平均净资产报酬率大于或等于同业平均。

根据这一标准初步筛选出 120 家上市公司供投资管理部门参考。分析师及基金经理再依具体情况对此初步基金备选库加以调整，加入诸如总市值，营业额或报酬率居行业排头公司，并删除炒作庄股及盈利质量较差的上市公司，以建立最终基金备选库。基本上每个月对基金备选库进行一次检讨，根据实际市场情况调整选取指标。

投资组合的构建

投资组合构建时的选股标准是根据基金经理人所采取的投资策略进行选取的。本基金根据基金管理人市场的判断采取弹性的投资策略，其具体的方法体现在投资指标的取诀。简而言之，投资指标可具体分为盈利增长指标，如 EPS Growth, PE/G；相对价值指标，如 PE, PB, EV/EBITDA；以及盈利质量指标，如 ROE, ROIC, EV/Sales 等。基金管理人根据其对市场情景判断决定投资策略，再根据投资策略选取相应的投资指标做为量化选股标准。一旦决定选股标准并建立不同标准的相应权重，再用加权排序的方式选取合适股票，供做投资组合构建的参考。

市场分析	底部区	复苏初期	牛市中期	市场高点	熊市
隐含投资风格	价值型投资策略	价值兼成长型投资策略	成长型投资策略	平衡型投资策略	保本型投资策略
不同股票选择指标的重要性					
盈利增长指标	低	中	高	低	中
相对价值指标	高	高	中	中	低
盈利质量指标	中	低	低	高	高
市场关注重点	价值及市场转折点	价值及基本面变化	后续成长动能	政策, 资金及技术指标	减仓加码债券

管理素质量化评级

本基金相当重视所投资公司的经营管理质量,其具体表现就在于本公司独有的管理素质量化评级。根据本基金的投资管理程序,所有被投资公司都需要通过管理素质量化评级表的审核,才能进入最终投资组合。此一量化评级表将公司管理层依十二项指标进行评价。由包括公司管理层对财务状况,市场竞争,公司优势,弱点的理解程度,争胜意志,战略规划及法律意识等各个面向进行全面的量化评比。最终评比分数须达到一定标准方得以进入本基金投资组合。

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

五、 基准指数选择

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×75%+中债总指数(全价)×20%+1年定期存款利率×5%。

沪深300股票指数由中证指数有限公司编制并发布,是由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成,于2005年4月8日正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。

中国债券总指数由中央国债登记结算公司编制并发布,首先从发布主体上保证中国债券总指数比较客观和专业;第二,本基金以中国债券总指数(全价)为业绩比较基准,是由于全价指数是以债券全价计算的指数值,债券付息后利息不再计入指数之中,比较科学且更切合实际。

如果中证指数有限公司或中央国债登记结算公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,或今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,

而无需召开基金份额持有人大会。

六、 投资管理的基本程序

本基金管理人的投资决策程序基本包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、建构股票池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估和信息反馈等七个步骤。

投资决策程序

步骤名称	主要内容	负责人/部门
1 投资决策委员会决策	投资决策委员会是公司的最高决策层。对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论,做出判断并形成决策报告,交由投资总监组织执行。	投资决策委员会
2 投资总监决策	投资总监对整个投资和交易业务负责,制定具体的投资策略和资产配置方案,并让投资人员贯彻执行已经形成决议的指令。	投资总监
3 构建股票池	计量分析师负责建立股票池,以此为深入研究的基础;就具体的投资工具和方法提出建议,与分析师和基金经理讨论如何完善量化模型。	计量分析师
4 研究选股及确认资产配置	分析师根据投资总监下达的任务进行独立的研究工作,包括公司调研,建立财务模型及撰写投资报告等。研究结果经研究会议讨论后,必要时做出修改并备案。	投资总监 分析师
5 建立投资组合	基金经理及分析师根据研究成果和投资会议结论达成初步选股及资产配置方案,并依次建立投资组合。	基金经理 分析师
6 风险评估	风险管理委员会、监察稽核部和风险管理部执行监督、检查和风险评估等功能,并依风险评估结果建议投资部门修正投资组合以达致兼顾投资报酬及风险的	风险管理委员会 监察稽核部 风险管理部

7 信息反馈	<p>最佳平衡点。</p> <p>投资部门根据有系统的公司调研及产业分析和风险管理部不间断的绩效评估,适时反映最新信息并做出投资组合的及时调整。</p>	<p>基金经理 分析师 风险管理部</p>
--------	--	-------------------------------

七、 投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定, 运作管理本基金:

1. 本基金投资组合应遵循下列规定:

- (1) 本基金投资于股票、存托凭证、债券的比例, 不低于本基金资产总值的 80%;
- (2) 本基金投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%;
- (3) 本基金持有 1 家上市公司的股票, 不超过本基金资产净值的 10%;
- (4) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有 1 家公司发行的证券的总和, 不超过该证券的 10%; 本基金管理人管理的全部开放式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%; 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%;
- (5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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本基金不符合本款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- (6) 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;
- (7) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行, 存托凭证与境内上市交易的股票合并计算;
- (8) 中国证监会规定的其它比例限制。
- (9) 上述比例受限于法律法规的不时修改和中国证监会不时颁布的规范性文件的规定。

2. 禁止用本基金资产从事以下行为:

- (1) 投资于其他证券投资基金;

- (2) 基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款；
- (3) 进行证券承销；
- (4) 从事证券信用交易；
- (5) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- (6) 以基金资产进行房地产投资；
- (7) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- (8) 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券；
- (9) 进行内幕交易、操纵市场；
- (10) 通过关联交易、利益输送等损害基金份额持有人的利益；
- (11) 配合基金管理人的发起人及其他任何机构的证券投资业务；
- (12) 届时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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。

九、 基金的融资

本基金的融资（如需要）应当按照届时有效的法律法规的规定进行。

第十三部分 基金的资产

一、基金资产总值

基金资产总值是指基金通过发行基金份额方式募集资金，并进行证券投资等交易所形成的各类资产的价值总和。

其构成主要有：

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

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价值。

基金份额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份额总数。

三、基金资产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“申万菱信盛利精选证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“申万菱信盛利精选证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国证监会备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册与过户登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户相独立。

四、基金资产的保管和处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金注册登记人和基金销售代理人以其自有的资产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。除依法法律

规和《基金合同》的规定处分外，基金资产不得被处分。

第十四部分 基金资产估值

一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

二、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。

三、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

四、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；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、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（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) 交易所上市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；

(3) 交易所上市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进行估值。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；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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) 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（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

4、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、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、基金管理人在履行适当程序后，当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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見，按照基金管理人對基金資產淨值的計算結果對外予以公布。

六、基金份額淨值的確認和估值錯誤的處理

各類基金份額淨值的計算均保留到小數點後4位，小數點後第5位四舍五入。當本基金估值導致任一類基金份額淨值小數點後4位以內的計算發生差錯時視為估值錯誤。估值錯誤實際發生時，基金管理人應當立即糾正，並採取合理的措施防止損失進一步擴大。當錯誤達到或超過該類基金份額淨值的0.25%時，基金管理人應報中國證監會備案；當估值錯誤偏差達到該類基金份額淨值的0.5%時，基金管理人應當公告，並報中國證監會備案。因基金估值錯誤給投資者造成損失的，應先由基金管理人承擔，基金管理人對不應由其承擔的責任，有權向過錯人追償。關於差錯處理，本合同的當事人按照以下約定處理：

1、差錯類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人、或注冊登記機構、或代理銷售機構、或投資者自身的過錯造成差錯，導致其他當事人遭受損失的，過錯的責任人應當對由於該差錯遭受損失的當事人（“受損方”）按下述“差錯處理原則”給予賠償承擔賠償責任。上述差錯的主要類型包括但不限於：資料申報差錯、數據傳輸差錯、數據計算差錯、系統故障差錯、下達指令差錯等；對於因技術原因引起的差錯，若系同行業現有技術水平無法預見、無法避免、無法抗拒，則屬不可抗力，按照下述規定執行。由於不可抗力原因造成投資者的交易資料滅失或被錯誤處理或造成其他差錯，因不可抗力原因出現差錯的當事人不對其他當事人承擔賠償責任，但因該差錯取得不當得利的當事人仍應負有返還不當得利的義務。

2、差錯處理原則

（1）差錯已發生，但尚未給當事人造成損失時，差錯責任方應及時協調各方，及時進行更正，因更正差錯發生的費用由差錯責任方承擔；由於差錯責任方未及時更正已產生的差錯，給當事人造成損失的由差錯責任方承擔；若差錯責任方已經積極協調，並且有協助義務的當事人有足夠的時間進行更正而未更正，則其應當承擔相應賠償責任。差錯責任方應對更正的情況向有關當事人進行確認，確保差錯已得到更正。

（2）差錯的責任方對可能導致有關當事人的直接損失負責，不對間接損失負責，並且僅對差錯的有關直接當事人負責，不對第三方負責。

（3）因差錯而獲得不當得利的當事人負有及時返還不當得利的義務。但差錯責任方

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资产损失时,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资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。

(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、行政法规、《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) 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的交易数据的,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;

(5) 基金管理人及基金托管人各类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人各类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

七、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时;

- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、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，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

八、特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第6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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其它不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十五部分 基金费用与税收

一、基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、证券交易费用；
- 5、基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、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

基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.40%的年费率计提。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、上述第一条基金费用中第4—8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，由基金托管人从基金资产中支付。

三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金成立前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十六部分 基金的收益与分配

一、基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其它收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

三、基金收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于基金净收益的90%；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的单位基金资产净值自动转为相应类别的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红利；
- 3、基金收益分配每年至少一次，成立不满3个月，收益不分配；
- 4、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；
- 5、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；
- 6、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 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

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

六、基金收益分配中发生的费用

1、红利分配采用再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者一定的比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定。

2、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，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的单位基金资产净值自动转为相应类别的基金份额。

第十七部分 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；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 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。

二、基金的年度审计

1、本基金管理人聘请具有证券、期货相关业务资格的德勤华永会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，可以更换。更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

第十八部分 基金的信息披露

本基金的信息披露将严格按照《基金法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件、《基金合同》、《信息披露办法》和其他有关规定进行。

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及其日常机构等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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（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。

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销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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。

一、招募说明书

本基金管理人依据《基金法》及相关法律法规、实施准则及基金合同编制并公告《招募说明书》。

二、份额发售公告

本基金管理人依据《基金法》及相关法律法规、实施准则的有关规定编制并发布份额发

售公告。

三、定期报告

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照《基金法》和中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等一系列有关证券投资基金信息披露的法规贬值，包括年度报告、中期报告、季度报告、基金资产净值公告及更新的招募说明书，并在指定媒介公告。

年度报告：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。

中期报告：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。

季度报告：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。

基金份额净值公告：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开放日的次日披露该开放日本基金各类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各类基金份额净值和基金份额累计净值。

更新的招募说明书：本基金合同生效后，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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者权益，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。

本基金持续运作过程中，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。

四、临时报告与公告

基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大

影响的事项之一时，信息披露义务人应按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告。

- 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、基金扩募；
- 4、延长基金合同期限；
- 5、转换基金运作方式、基金合并；
- 6、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；
- 7、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；
- 8、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 9、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；
- 10、基金募集期延长；
- 11、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；
- 12、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；
- 13、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 14、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；
- 15、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；
- 16、基金收益分配事项；
- 17、管理费、托管费、申购费、赎回费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 18、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 19、开放式基金开始办理申购、赎回；
- 20、基金发生巨额赎回并延期办理；

- 21、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；
- 22、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 23、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；
- 24、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；
- 25、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其他事项。

五、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介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。

六、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备案，并予以公告。

七、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。

八、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、各类基金份额净值、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。

九、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公司住所，供社会公众查阅、复制。

十、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第十九部分 基金的终止与清算

一、基金的终止

有下列情形之一的，本基金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100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，而无其它适当的基金管理公司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，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；
- 6、中国证监会允许的其它情况。

二、基金清算小组

1、基金清算小组：自基金终止之日起30个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金清算小组组成：基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、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、基金清算小组职责：基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

4、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；
- (2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行估值和变现；
- (4) 对基金资产进行分配。

三、清算费用

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

1、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2、基金清算的公告

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

3、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。

第二十部分 业务规则

基金份额持有人应遵守《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》（以下称《业务规则》）。《业务规则》由基金管理人制订，并由其解释与修改，但《业务规则》的修改若实质修改了《基金合同》，则应召开持有人大会，对《基金合同》的修改达成决议。

第二十一部分 违约责任

一、由于《基金合同》当事人的过错，造成《基金合同》不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属《基金合同》当事人双方或多方当事人的过错，根据实际情况，双方或多方当事人应当按照法律法规和《基金合同》的规定分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

- 1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章

的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有故意或过失的情况下，基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则而投资或不投资而造成的损失等；

3、不可抗力。

二、《基金合同》当事人违反《基金合同》，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

三、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。未违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。

第二十二部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。《基金合同》受中国法律管辖。

第二十三部分 《基金合同》的效力

《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、《基金合同》经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。

2、《基金合同》的有效期限自其生效之日起至本基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金发起人、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。

4、《基金合同》正本一式八份，除上报有关监管机构二份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；也

可按工本费购买《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。

第二十四部分 《基金合同》的修改和终止

一、《基金合同》的修改

1、修改《基金合同》应当经过《基金合同》当事人的同意；

2、修改《基金合同》应当召开基金份额持有人大会，《基金合同》修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过。

3、以上修改须报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属本《基金合同》应当遵照进行修改的情形或《基金合同》的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

二、《基金合同》的终止

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100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，而无其它适当的基金管理公司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，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；

(6) 中国证监会允许的其它情况。

2、《基金合同》的终止。

本基金终止后，须依法和《基金合同》对基金进行清算。《基金合同》于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

第二十五部分 其它事项

基金合同的当事人应遵守《申万菱信基金管理公司开放式基金业务规则》。该规则由基金管理人制订，并由其解释和修改，但规则的修改若实质性地修改了《基金合同》，应召开基金份额持有人大会，对《基金合同》的修改达成决议并通过。本《基金合同》如有未尽事宜，由本《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。