

**泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业
证券投资基金、稳定类行业证券投资基金
更新招募说明书**

基金管理人：泰达荷银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金于 2003 年 2 月 13 日获中国证监会证监基金字【2003】21 号文批准募集，基金合同于 2003 年 4 月 25 日正式生效。

本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。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示本基金的未来表现。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新招募说明书已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核，所载内容截止日为 2009 年 10 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

目 录

一、绪言	3
二、释义	4
三、基金管理人	7
四、基金托管人	15
五、相关服务机构	18
六、基金份额的申购、赎回和基金间转换	34
七、基金的投资	43
八、基金的业绩	55
九、基金的财产	60
十、基金资产的估值	61
十一、基金的收益和分配	68
十二、基金的费用与税收	69
十三、基金的会计与审计	73
十四、基金的信息披露	74
十五、风险揭示	77
十六、基金的终止与清算	79
十七、基金合同内容摘要	81
十八、基金托管协议的内容摘要	95
十九、基金份额持有人的服务	101
二十、其他应披露事项	103
二十一、招募说明书存放及查阅方式	104
二十二、备查文件	104

一、 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)等有关法律、法规、规章以及《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本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。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

泰达荷银系列基金或本系列基金：指泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金共同构成的泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金

合丰成长：指泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金

合丰周期：指泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金

合丰稳定：指泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金

本系列基金合同或基金合同：指《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》

《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及立法机关对其不时所作的修订

《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时所作的修订

《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金运作管理办法》

《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金销售管理办法》

《信息披露办法》：指 2004 年 6 月 8 日中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露管理办法》

招募说明书：指《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金招募说明书》

更新招募说明书：指本系列基金合同生效后对招募说明书定期更新的文件

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

元：指人民币元

本系列基金合同当事人：指受本系列基金合同约束，根据本系列基金合同享有权利并承担义务的基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

基金管理人：指泰达荷银基金管理有限公司

基金托管人：指交通银行股份有限公司

注册登记业务：指本系列基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额的注册登记、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

注册登记机构：指办理本系列基金注册登记业务的机构。本系列基金的注册登记机构为泰达荷银基金管理有限公司或接受泰达荷银基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记业务的机构

代销机构：指符合中国证监会等监管机构规定的条件并与基金管理人签订了销售代理协议，代为办理本系列基金销售业务的机构

直销机构：指泰达荷银基金管理有限公司

基金份额发售机构：指直销机构和代销机构

个人投资者：指依法可以投资证券投资基金的自然人

机构投资者：指依据有关法律、法规、规章可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

基金投资者：指个人投资者和机构投资者

基金份额持有人：指依法或依本系列基金合同、招募说明书或定期更新的招募说明书取得基金份额的投资者

基金合同生效日：指 2003 年 4 月 25 日

基金的终止日：指本系列基金合同规定的基金终止事由出现后按照本系列基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金的日期

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日

存续期：指本系列基金合同生效日至终止日之间的不定期期限

工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

T 日：指销售机构受理投资者申购、赎回、基金间转换或其他业务的申请日

T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

认购：指在本系列基金设立募集期内，投资者申请购买基金份额的行为

申购：指在本系列基金合同生效后投资者申请购买基金份额的行为

赎回：指本系列基金某只行业类别基金份额持有人按本系列基金合同规定的条件，要求基金管理人购回基金份额的行为

基金间转换：指本系列基金存续期间，基金管理人根据持有本系列基金某只行业类别基金份额持有人的申请，在本系列基金范围内将其持有的某只行业类别基金份额转换为其它行业类别基金份额或与本基金管理人管理的其他基金之间的转换行为

巨额赎回：指基金单个开放日，某只行业类别基金赎回申请份额总数（包括基金间转换导致的该只行业类别基金减少的份额）扣除申购份额和其它行业类别基金转换为该基金份额后的总余额超过上一日该基金总份额的 10%时的情形

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

基金收益：指某只行业类别基金投资所得红利、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：指某只行业类别基金购买的各种证券、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：指某只行业类别基金资产总值减去该基金负债后的价值

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

基金账户：指基金注册登记机构为投资者开立的记录其持有泰达荷银系列基金的基金份额及其变更情况的账户

指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

不可抗力：指任何无法预见、无法克服的事件或因素，包括：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或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

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

公司名称：泰达荷银基金管理有限公司

成立日期：2002年6月6日

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577725

联系人：邢颖

注册资本：1.8亿元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51%；荷银投资管理（亚洲）有限公司：49%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

刘惠文先生，董事长。毕业于吉林大学经济系，经济学学士学位，高级经济师。1996年至2001年任天津泰达集团有限公司总经理。自2001年起担任天津泰达投资控股有限公司董事长兼总经理。自2005年起兼任渤海财产保险股份有限公司、北方国际信托股份有限公司等核心企业的董事长。

刘振宇先生，董事。毕业于天津师范大学，拥有法学学士学位和经济学硕士学位，律师、经济师、项目数据分析师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年起任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。

马军先生，董事。毕业于天津大学管理工程系，工学学士学位，经济师、项目数据分析师。2002年起任天津泰达担保有限公司常务副总经理。2005年起任天津泰达投资控股有限公司财务中心副主任。

黄金源（Alex K.G. Ng）先生，董事。马来西亚籍。美国加州大学洛杉矶分校经济学专业毕业。1983年起，先后在美国美林公司任投资人员、在马来西亚任金融研究

员。1988年在新加坡加盟荷兰银行，后调荷银证券香港分公司。目前担任荷银投资管理（亚洲）有限公司亚太区投资总监。

何国良先生，董事。毕业于香港中文大学统计学专业，哲学硕士学位，特许金融分析师（CFA）。1994年至1997年任职于GMO（香港）有限公司，担任高级定量分析师；1997年至2004年任职于荷银投资管理（亚洲）有限公司，先后担任高级投资组合经理、研究部主管；2004年至2005年任职于国海富兰克林基金管理有限公司，担任研究部总经理；2005年至今，担任荷银投资管理（亚洲）有限公司香港和中国大陆股票投资主管。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，兼任《财经》杂志学术顾问。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，中国政法大学法学硕士学位，1995年获法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、清华大学经管学院和国家会计学院副教授、安信信托投资股份有限公司总裁。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人。

孔晓艳女士，独立董事，毕业于中山大学法律系，法学硕士学位，一级律师。1993年至1997年任天津市对外经济律师事务所专职律师。1997年至1999年任香港Livasari&Co.律师行中国法律顾问。1999年至2004年任嘉德律师事务所专职律师、高级合伙人。2004年至今任嘉德恒时律师事务所专职律师、高级合伙人。

范小云女士，独立董事，毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年还担任《南开经济研究》副主编。2005年起任中国金融学会理事。

2、监事会成员

邢吉海先生，监事。毕业于天津干部管理学院财会专业，会计师。1995年至1997

年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局。2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任。2001年起任天津泰达投资控股有限公司监事、财务中心主任。

潘孝祖先生，监事。毕业于香港树仁学院，持有会计文凭，并为英国特许公认会计师公会资深会员（ACCA），香港会计师公会会员（HKCPA）及美国特许金融分析师（CFA）。1984年以来，先后任职于陈施会计师事务所、荷兰银行、荷兰证券，以及荷银资产管理公司。现任荷银资产管理亚太区营运总监，负责亚太区内10个国家和地区的后勤支持工作。

王泉先生，监事。管理学学士、经济学硕士。2002年3月加入泰达荷银基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

缪钧伟先生，总经理。毕业于复旦大学和香港城市大学，获得理学学士、经济学硕士和金融学博士学位；1998年10月至2003年2月任证监会基金部副处长；2003年3月至2006年8月任海富通基金管理有限公司副总经理。2007年2月起任泰达荷银基金管理有限公司总经理。

刘青山先生，副总经理兼投资研究总监。毕业于中国人民大学，获史学学士和管理学硕士。1997年就职于华夏证券基金部，参与筹建华夏基金管理公司，从事投资研究工作。2001年起参与筹建湘财合丰基金管理有限公司（泰达荷银基金管理有限公司前身）并工作至今，期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监，投资总监兼经理助理。2006年11月起任泰达荷银基金管理有限公司副总经理兼投资研究总监。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位。1993年至2006年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达荷银基金管理有限公司财务总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和企业管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达荷银基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达荷银基金管理

有限公司督察长。

4、基金经理

(1) 合丰成长基金：

王勇先生，合丰成长基金基金经理，毕业于北京工业大学，获工学硕士学位。1999年8月至2001年11月期间就职于中国投资咨询公司，任投资顾问；2001年11月至2004年2月期间就职于北京海问投资咨询有限责任公司，任研究员；2004年2月至2004年11月就职于航空证券有限责任公司，任研究员。2004年11月加盟泰达荷银基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理、研究主管等职务。自2008年8月起担任合丰成长基金基金经理。9年证券从业经验，4年基金从业经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2005年4月由刘青山先生担任基金经理。自2005年4月起至2008年8月由梁辉先生担任基金经理。

(2) 合丰周期基金：

吴俊峰先生，合丰周期基金基金经理。毕业于中国人民银行金融研究所，获经济学硕士学位。2005年5月至2005年8月期间就职于国信证券经济研究所，任研究员。2005年8月加盟泰达荷银基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管等职务。自2009年3月至今，担任泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金(合丰周期基金)基金经理。4年基金从业经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2004年7月由曾昭雄先生担任基金经理；自2004年7月至2005年2月由史博先生担任基金经理；自2005年2月至2007年4月由温震宇先生担任基金经理。自2007年3月20日至2008年8月5日，由魏延军先生担任基金经理；自2007年11月至2009年5月，由梁辉先生担任基金经理。

(3) 合丰稳定基金：

胡涛先生，合丰稳定基金基金经理。美国印第安纳大学凯利商学院 MBA, CFA, 1999年7月至2000年7月就职于北京证券有限责任公司任投资银行部经理，2002年6月至2003年6月就职于中国国际金融有限公司任股票研究经理，2003年7月至2004年4月就职于长盛基金管理有限公司任研究员，2004年9月至2007年4月就职于友邦华泰基金管理有限公司任基金经理助理。胡涛先生于2007年4月加盟泰达荷银基金管理有限公司，先后担任专户投资部副总经理、研究部研究主管等职务，6年基金

从业经验，5年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2005年4月由康赛波担任基金经理；自2005年4月至2005年9月由吴剑飞担任基金经理；自2005年9月至2009年6月由李泽刚担任基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理缪钧伟、副总经理兼投资总监及基金经理刘青山、基金投资部总经理及基金经理梁辉、研究部总监及基金经理陈少平、交易部负责人陈力、督察长兼风险管理与基金评估部总监张萍、专户投资部总经理、首席策略分析师及投资经理尹哲、专户投资部投资经理郭飞舟、国际投资部副总监胡兴、固定收益部总经理及基金经理沈毅以及基金经理王勇、吴俊峰、许杰、胡振仓、胡涛。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理本基金备案手续；

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、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《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《证券法》行为的发生；

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

- (1) 基金之间相互投资；
- (2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- (3) 从事任何形式的证券承销或者从事除证券监管机构允许以外的其他证券自营业务；
- (4) 从事资金拆借业务；
- (5) 动用银行信贷资金从事基金投资；
- (6) 将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- (7) 从事证券信用交易；
- (8) 以基金财产进行房地产投资；
- (9) 从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- (10) 将基金财产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、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、规章及行业规范，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) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (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) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒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。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，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组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
- (2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；
- (3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；
- (4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。董事会下设合规控制委员会、资格审查委员会和薪酬委员会。

督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向合规控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

风险控制委员会：负责对公司营运和基金投资运作的风险进行全面测量和监控。

监察稽核部和风险管理部：分别负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控体系，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

(2) 建立相互独立、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到公司资产和基金资产独立、投资决策独立，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了风险控制小组，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的

培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、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。

四、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：489.94亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-68888917

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志2009年7月发布的全球1000家银行排名，交通银行总资产排名位列第56位，一级资本排名位列第49位。截止2009年6月末，交通银行总资产超过人民币3万亿元，2009年上半年实现净利润人民币155.79亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员

工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实守信、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二) 主要人员情况

李军先生，交通银行行长，华中理工大学经济学硕士，高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长，交通银行总稽核、董事、常务董事、执行董事、副行长；2006年9月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

(三) 基金托管业务经营情况

截止2009年6月末，交通银行共托管证券投资基金44只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、融通行业景气混合、泰达荷银成长股票、泰达荷银风险预算混合、泰达荷银稳定股票、泰达荷银周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过五千亿元。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、全面性原则：通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，建立全面的风险管理监督机制。

2、独立性原则：交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置账户，独立核算，分账管理。

3、制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

4、有效性原则：在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

5、效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部内部风险控制制度》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》、《交通银行资产托管部监察守则》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

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

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

五、相关服务机构

（一）直销机构

泰达荷银基金管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮编：100140

传真：010—66577666

客户服务电话：400-698-8888（免长话费）或010-66555662

联系人：延慧、潘静

联系电话：010-66577619、010-66577668

网址：<http://www.aateda.com>

网上直销网址：<https://etrade.aateda.com/etrading/>

（二）代销机构

1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

银行网站：www.icbc.com.cn

2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

联系电话：010-85109211

传真：010-85109219

联系人：蒋浩

银行网站：www.abchina.com

4) **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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖 钢

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

5) **交通银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

联系人：曹榕

银行网址：www.bankcomm.com

6) **招商银行股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

客服电话：95555

联系人：兰奇

公司网站：www.cmbchina.com

7) **上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：金运

客服电话：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

公司网址：www.spdb.com.cn

8) **深圳发展银行股份有限公司**

注册地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼

客户服务电话：95501

联系人：周勤

传真：0755-82080714

公司网址：www.sdb.com.cn

9) **兴业银行股份有限公司**

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市五一中路元洪大厦 25 层

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561，021-62677777

传真：021-62569070

联系人：陈晓瑾

网站：www.cib.com.cn

10) **中信银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人： 孔丹
电话： (010)6554-1585 (北京)
传真： (010)6554-1230 (北京)
联系人： 王斌
客服电话： 95558
网址： bank.ecitic.com

11) **东莞银行股份有限公司**

注册地址： 东莞市运河东一路 193 号
办公地址： 东莞市运河东一路 193 号
法定代表人： 廖玉林
电话： 0769-22119061
传真： 0769-22117730
联系人： 胡昱
客服电话： 0769-22118118 或拨打各营业网点咨询电话
公司网址： www.dongguanbank.cn

12) **湘财证券有限责任公司**

注册地址： 湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址： 湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人： 林俊波
客服电话： 400-888-1551
传真： 021- 68865680
联系人： 李梦诗
联系电话： 021-68634518-8631
公司网站： www.xcsc.com

13) **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一大街 29 号

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：张志军

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

电子邮箱：wangzq@bhqz.com

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhqz.com

14) 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 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：胡长生

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568047

联系人：李洋

公司网站：www.chinastock.com.cn

15) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

客服电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

16) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客服电话：4008888108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：祝幼一

客服电话：4008888666

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

18) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：袁月

全国免费业务咨询电话：4008816168

传真：0755-82433794

网址：www.PINGAN.com

19) 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 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

客服电话：95503

联系人：吴宇

公司网站: www.dfzq.com.cn

20) 世纪证券有限责任公司

注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人: 卢长才

联系人: 王飞

客服电话: 0755-83199511

公司网站: www.csc.com.cn

21) 申银万国证券股份有限公司

注册地址: 上海市常熟路 171 号

办公地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

联系人: 李清怡

联系电话: 021-54033888

客服电话: 021-962505

网址: www.sw2000.com.cn

22) 齐鲁证券有限公司

注册地址: 济南市经十路 128 号

法定代表人: 李玮

客服电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

23) 中银国际证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人: 唐新宇

客服电话：4006208888
传真：021-50372474
联系人：张静
公司网站：www.bocichina.com.cn

24) 华泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户服务电话：025-84579897
传真：025-84579879
联系人：张小波、李金龙
公司网站：www.htsc.com.cn

25) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
联系电话：0755-82492000
客户服务电话：400-8888-555，0755-25125666
传真：0755-82492962
公司网址：www.lhzq.com

26) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨

客户服务电话：4008888788 10108998

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

27) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区成府路 298 号方正大厦二层

办公地址：北京市西城区月坛大厦 15 层

法定代表人：马金声

联系人：戴荻

客户服务电话：4006989898

公司网址：www.xsdzq.cn

28) 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 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄健

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

29) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

传真：0755-83516199

客户服务电话：0755-33680000 400 6666 888

公司网址：www.cc168.com.cn

30) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：徐翔

联系电话：025-83367888

客户服务电话：400 828 5888

公司网址：www.njzq.com.cn

31) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客户服务电话：4008888123

公司网址：www.xyzq.com.cn

32) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：400-8888-001（全国） 021-95553

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

33) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 5 楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 5 楼

法定代表人：吴志明

客服电话：020-961303

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：樊刚正

网址：www.gzs.com.cn

34) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591-87383333，96326（福建省内）

传真：0591-87383610

联系人：张腾

公司网站：www.gfhfzq.com.cn

35) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

公司网站：www.guosen.com.cn

36) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛
客户服务电话：4008-888-228
传真：0755-83025625
联系人：金春
网站：www.jyzq.cn

37) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼
法定代表人：王军
客服电话：021-68590808
传真：021-68767981
联系人：罗芳
公司网站：www.tebon.com.cn

38) 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
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
法人代表人：牛冠兴
开放式基金咨询电话：4008001001
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82558305
网址：www.essence.com.cn

39) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼
法定代表人：朱科敏
联系人：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网络地址：www.longone.com.cn

客户服务热线：021-52574550，0519-8166222，0379-64912266

免费服务热线：400-888-8588

40) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：王少华

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

41) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-4403319

开放式基金业务传真：0731-4403439

网址：www.cfzq.com

42) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：62267799

客服电话：4008-000-562

网址: www.hysec.com

43) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

客户服务热线: 4008-888-999 或 027-85808318

联系人: 李良

电话: 021-63219781

传真: 021-51062920

长江证券客户服务网站: www.95579.com

44) 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

办公地址: 北京市金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人: 林义相

联系电话: 010-66045522

联系人: 陈少震

公司网站: www.txsec.com

(三) 注册登记机构

名称: 泰达荷银基金管理有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人: 刘惠文

联系人: 王泉

电话: 010-66577768

传真: 010-66577750

(四) 律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：廖海、毛慧

（五）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

六、基金份额的申购、赎回和基金间转换

（一）申购、赎回和基金间转换的办理时间

1、开放日

本系列基金开放日为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。

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

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购的开始日及业务办理时间

本系列基金自基金合同生效后不超过 30 个工作日起开始办理申购。具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

3、赎回和基金间转换的开始日及业务办理时间

本系列基金自基金合同生效后不超过 30 个工作日起开始办理赎回，本系列基金自基金合同生效日后不超过 90 个工作日起开始办理基金间转换。具体业务办理时间在赎回和基金间转换开始公告中规定。

在确定申购开始、赎回和基金间转换开始时间后，由基金管理人最迟于开始日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（二）申购、赎回和基金间转换的场所

本系列基金的销售机构包括直销机构和基金管理人委托的代销机构。投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购、赎回和基金间转换。

（三）申购、赎回和基金间转换的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回、基金间转换价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回、基金间份额转换”原则，即申购以金额申请，赎回、基金间转换以持有的基金份额申请。

3、当日的申购、赎回和基金间转换申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、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。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（四）申购、赎回和基金间转换的程序

1、申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。

2、申购、赎回和基金间转换的确认与通知

（1）申购、赎回的确认与通知：T 日提交的有效申请，本系列基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请申购与赎回的确认情况。

（2）基金间转换的确认与通知：T 日提交的有效申请，本系列基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询基金转换的确认情况。

3、申购、赎回款项和基金间转换份额的支付：基金申购采用全额缴款方式。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在 T+7 日内支付。在发生延期支付的情形时，款项和份额的支付办法参照本系列基金合同的有关条款处理。

4、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，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

5、申购、赎回和基金份额转换的数额约定：投资人按金额申购基金，首次申购每只行业类别基金最低金额 500 元，已有认购记录的投资者不受本限制；追加申购每只行业类别基金最低金额为 100 元。投资者当期分配的某只行业类别基金收益转购该基金份额时不受最低申购金额的限制。基金申购份额计量单位为份基金单位，基金单位份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分归基金资产。

投资人赎回和基金间转换时按份额赎回和基金份额转换基金，基金份额持有人可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回和基金间转换。每只行业类别基金单笔赎回最低份数为 100 份；赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分归基金资产。每支行业类别基金单笔基金转换最低份数为 500 份；基金间转换份额计量单位为份基金单位，基金单位份数保

留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分归基金资产。当持有人持有某只基金份额低于 100 份时，基金管理人有权要求将该持有人持有的该基金份额全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，调整结果必须至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

(五) 申购、赎回的费用和基金间转换的费用

1、申购费率

本基金的申购费用由基金份额持有人承担，不列入基金财产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金的申购费用采用前端收费形式，申购费率具体如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M<50万	1.5%
50万 ≤ M<250万	1.2%
250万 ≤ M<500万	0.75%
500万 ≤ M<1000万	0.5%
M ≥ 1000万	每笔1000元

注：网上直销等特殊申购费率另见已发布的相关公告

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，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。

2、赎回费率

赎回费率如下：

连续持有期限 (日历日)	适用的赎回费率
1 天—365 天	0.5%
366 天 (含) —730 天	0.25%
731 天 (含) 以上	0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本系列基金任意一子基金连续持有期限超过 365 天，赎回费率为 0.25%；连续持有期限超过 730 天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的 25%划归基金资产。

3、基金间转换费率

(1) 本系列基金之间转换不收费；

(2) 本系列基金、荷银预算、荷银精选基金转换费为 0.25%；

(3) 荷银货币基金与本系列基金之间转换：

A、由荷银货币基金转入本系列基金，转换费率按如下方式确定：

适用于认购期间购买的荷银货币基金份额：

基金份额持有时间	转换费率
1 天~90 天	本系列基金的申购费率
91 天（含）以上	0

适用于申购期间购买的荷银货币基金份额：

基金份额持有时间	转换费率
1 天~90 天	本系列基金的申购费率
91 天（含）~365 天	本系列基金的申购费率-0.25%
366 天（含）~730 天	本系列基金的申购费率-0.5%
731 天（含）以上	0

B、由本系列基金转出至荷银货币基金，转换费率为转换申请日的本系列基金所适用的赎回费率。

(4) 荷银首选基金、荷银市值基金与本系列基金之间的转换：

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。基金转换费用中的赎回费的 25%归入基金资产。具体公式如下：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金单位资产净值

转换费用：

如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率，

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率 + 转出金额 × 转出基金与转入基金的申购费率差

如果转出基金的申购费率 > 转入基金的申购费率，

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

转入金额 = 转出金额 - 转换费用

转入份额 = 转入金额 ÷ 转入基金当日基金单位资产净值

(5) 本公司可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同规定的前提下，在与托管银行和代销机构协商一致后对上述收费方式和费率进行调整，但最迟应于调整后的收费方式和费率实施前 2 个工作日在指定媒体上公告。

4、本基金申购、赎回、基金间转换费率由基金管理人决定，并在招募说明书或更新招募说明书中逐一系列示。基金管理人有权根据市场情况在法律法规规定的限额内调整收费方式及相关费率，但最迟应与调整实施前两日内在至少一种中国证监会指定报刊和网站上公告。

(六) 申购份额、赎回金额和转换份额的计算方式

1、基金申购份额的计算

申购份额为申购金额减去申购费用后除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，基金单位份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分归基金资产。

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

基金申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金单位净值

2、基金赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回费用，赎回金额单位为元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分归基金资产。

赎回费用 = (赎回份额 × 基金份额净值) × 赎回费率

赎回金额 = (赎回份额 × 基金份额净值) - 赎回费用

3、基金转换份额的计算

假设某基金份额持有人欲将原持有的某基金 B 转换为另一基金 A，基金间转换公

式为：

$$A = [(B \times B_{nav} \times (1 - E)) / A_{nav}]$$

其中： A 为基金间转换后可得到的基金 A 的份额；

B 为原来持有的基金 B 的份额；

B_{nav} 为基金间转换当日基金 B 的份额资产净值；

E 为基金间转换费率；

A_{nav} 为基金间转换当日某基金 A 的每份额资产净值。

基金转换份额计量单位为份基金单位，基金单位份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金资产。

由于基金净值的不同，持有人将原持有基金 B 转换为另一基金 A 时，原持有基金的份额可能与基金间转换后所得基金份额存在差异。

4、基金份额净值的计算

基金份额净值等于当日基金资产净值除以基金总份额。

（七）申购、赎回和基金间转换的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益，投资者在 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金或基金间转换后的基金份额。投资者赎回或基金间转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益。

（八）拒绝或暂停申购、赎回和基金间转换的情形与处理

1、出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购和基金间转换申请：

（1）不可抗力；

（2）证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日某行业类别基金资产净值；

（3）基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购和基金间转换可能对已有的某只行业类别基金份额持有人利益产生损害；

（4）基金管理人认为会严重损害已有某只行业类别基金份额持有人利益的其他

申购和基金间转换；

(5) 基金管理人、基金托管人、基金代销机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(6) 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某只行业类别基金申购或基金间转换，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告；

(7) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

2、拒绝或暂停赎回和基金间转换的情形和处理

发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回和基金间转换申请：

(1) 不可抗力；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 连续两个开放日发生巨额赎回；

(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已确认的赎回和基金间转换申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回和基金间转换申请人，未支付部分可延期支付，在后续开放日予以支付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日。

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赎回和基金间转换，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回和基金间转换业务的办理。

(九) 巨额赎回的情形及处理

1、巨额赎回的认定

基金单个开放日，本系列基金某只行业类别基金赎回申请份额总数（包括基金间转换导致该只行业类别基金减少的份额）扣除申购份额和其它行业类别基金、本基金管理人管理的其他基金转换为该基金份额后的总余额超过上一日该基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理

(1) 全额赎回和基金间转换：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回和基金间转换时，按正常赎回和基金间转换程序执行。

(2) 顺延赎回和基金间转换：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回和基金间转换比例不低于该行业类别基金总份额的 10%的前提下，可以对其余赎回申请延期办理，基金间转换不能申请延期办理。对于当日的赎回和基金间转换申请，应当按单个账户赎回和基金间转换申请量占赎回和基金间转换申请总量的比例，确定当日受理的赎回和基金间转换份额；未受理赎回部分可延迟至下一个开放日办理，但投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤消。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以该下一个开放日的该行业类别基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。发生巨额赎回和基金间转换并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者《基金合同》、《招募说明书》规定的其他方式、在规定的时间内通知基金投资人，说明有关处理方法。同时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告，通知投资者，并说明有关处理方法；通知和公告的时间最长不得超过三个证券交易所交易日。

(3) 基金连续两个开放日以上发生巨额赎回和基金间转换，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回和基金间转换申请；已经确认的赎回和基金间转换申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(十) 暂停申购、赎回或基金间转换的公告和重新开放申购、赎回或基金间转换的公告

发生上述暂停申购、赎回或基金间转换情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

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至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购、赎回或基金间转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告，并在重新开放申购、赎回或基金间转换

日公告最近 1 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、赎回或基金间转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告并在重新开放申购、赎回或基金间转换日公告最近一个开放日的基金份额净值。

七、基金的投资

（一）投资目标

合丰成长、合丰周期、合丰稳定分别主要投资于成长、周期、稳定三个行业类别中内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下，为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。

（二）业绩比较基准

合丰成长：65%×新华富时 A600 成长行业指数+35%×上证国债指数

合丰周期：65%×新华富时 A600 周期行业指数+35%×上证国债指数

合丰稳定：65%×新华富时 A600 稳定行业指数+35%×上证国债指数

（三）投资范围和投资对象

合丰成长、合丰周期、合丰稳定是三只相互独立的行业类别证券投资基金，共同构成本系列基金。本系列基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。合丰成长、合丰周期、合丰稳定的股票投资部分分别主要投资于成长、周期、稳定三个行业类别中依据市净率（P/B）和市盈率与每股预期收益增长率之比（PEG）所确定的具有增长潜力的价值型股票，即本系列基金所定义的价值优化型股票。在股票投资中严格遵循：（1）各行业类别基金投资于该基金类型所对应行业类别股票的比重不低于该基金股票净值的 80%（一级市场认购股票除外）；（2）各只行业类别基金的股票投资以价值优化型股票为主要投资对象。

根据中国证监会公布的行业划分标准，及对各行业与宏观经济发展的相关性分析，本系列基金管理人将各行业分类如下：

成长类	周期类	稳定类
电子 C5	纺织、服装、皮毛 C1	农、林、牧、渔业 A
信息技术 G	造纸、印刷 C3	食品、饮料 C0
传播与文化产业 L	石油化工、化学、塑胶、塑料 C4	木材、家具 C2
医药与生物制品 C8	金属、非金属 C6	电力、煤气及水的生产供应业 D
	机械、设备、仪表 C7	交通运输、仓储业 F

	其他制造业 C9	批发和零售贸易 H
	建筑业 E	金融、保险业 I
	房地产业 J	社会服务业 K
	采掘业 *B	

注：1、表中代码为中国证监会行业指定代码。

2、国际上通常将行业划分为成长、周期、稳定及能源四个类别。由于能源类企业生产中间产品，为制造业及消费者提供最基本的生产资料，并且我国目前能源类上市公司数量较少、总体公司市值较低，因此将能源类行业—采掘业归入周期类。

合丰成长基金的投向除成长类所包括的 5 个行业外，还包括分布在其他行业类别中受国家产业政策重点支持和鼓励发展的高新技术行业，如新技术、新材料、高新农业及环境保护等。

综合类上市公司中，若其在某一行业类别中的业务收入占主营业务收入的 50% 以上，则该上市公司归入相应行业类别基金投资范围。

基金管理人可以根据国家有关部门或权威机构行业划分标准，及各行业与宏观经济发展相关性的变化，对各行业类别基金所覆盖的相关行业进行适当调整，但须及时予以披露。

除非主管部门或权威机构的行业划分规则发生改变，本系列基金管理人不会主动改变本系列基金的行业归类。

（四）投资理念

投资基于价值，成长终将在价值中得到体现。

（五）投资策略

本系列基金每只行业类别基金采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。

本系列基金管理人根据对宏观经济变化、资本市场发展动态及行业结构调整的分析判断，确定本系列基金每只行业类别基金在股票、债券、现金和其它投资品种间的资产配置比例，并通过对国家产业政策、行业发展状况的分析研究，确定各行业类别基金的行业配置比例。

在资产配置、行业配置完成后，基金管理人主要通过 P/B、PEG 指标来确定价值优化型股票，在个股 PEG 值计算中，本系列基金管理人从以下几个方面评估上市公司的每股预期收益增长率 G：

- 公司的商业模式
- 所处行业发展前景
- 产品市场前景分析，包括产品本身市场分析、主要竞争对手、上下游产品关联性 & 定价能力、替代产品分析等
- 公司的核心竞争力分析，包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等
- 公司财务状况及财务管理能力，包括财务安全性指标，反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等
- 公司潜在风险及应对措施

以价值优化型股票为基础，结合考虑满足以下条件的相关股票，组成本系列基金股票备选库：

- i. 股票 P/B、PEG 某单项指标特优，另一项指标未能反映其真实状况。
 - ii. 上市公司资产重组或生产经营管理方面发生重大改变，将可能会对公司经营业绩和未来发展前景产生重大和实质性影响。
 - iii. 公司拥有未被市场认识的或被市场低估的资源，导致公司会计帐面值低于公司内在价值。
 - iv. 研究部利用其它股票定价模型分析确定的投资价值被严重低估的股票。
- 基金经理在股票备选库的范围内进行股票投资。

（六）投资限制

本系列基金每只行业类别基金投资组合符合以下规定：

- 1、每只行业类别基金投资于股票、债券的比重不低于该基金资产总值的 80%，投资于国债的比重不低于该基金资产净值的 20%；
- 2、每只行业类别基金投资于一家上市公司股票的比例不超过该基金资产净值的 10%；
- 3、每只行业类别基金与由本系列基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和不超过该证券的 10%；

4、各行业类别基金投资于该基金类型所对应行业类别股票的比重不低于该基金股票净值的 80%（一级市场认购股票发行除外）。

5、遵守相关法律、法规规定的其他比例限制。

由于证券市场波动或投资组合处于调整过程中，造成本系列基金某只行业类别基金在某一时间无法达到上述比例限制，本系列基金管理人将在 10 个工作日内积极调整该基金投资组合，以达到上述比例限制。

（七）禁止行为

- 1、 投资于其他基金；
- 2、 以本系列基金某只行业类别基金的名义使用不属于该基金名下的资金买卖证券；
- 3、 将本系列基金某只行业类别基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 4、 从事证券信用交易；
- 5、 以本系列基金某只行业类别基金资产进行房地产投资；
- 6、 从事可能使本系列基金某只行业类别基金资产承担无限责任的投资；
- 7、 将本系列基金某只行业类别基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 8、 进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 9、 配合管理人的发起人、本系列基金发起人及其他任何机构的证券投资业务；
- 10、 故意维持或抬高管理人的发起人、本系列基金的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；
- 11、 中国证监会禁止从事的其他行为。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定时从其规定。

（八）基金管理人代表本系列基金每只行业类别基金行使股东权利的处理原则和方法

- 1、 不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、 有利于本系列基金资产的安全和增值；
- 3、 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本系列基金行使股东权利。

(九) 基金投资组合报告 (未经审计)

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

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 11 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2009 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

合丰成长基金

(一) 报告期末基金资产组合 (单位: 元)

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	604,964,028.13	59.37
	其中: 股票	604,964,028.13	59.37
2	固定收益投资	217,928,651.40	21.39
	其中: 债券	217,928,651.40	21.39
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	189,443,467.41	18.59
6	其他资产	6,709,719.55	0.66
7	合计	1,019,045,866.49	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位: 元)

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	459,871,225.99	45.66
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-

C4	石油、化学、塑胶、塑料	65,199,972.80	6.47
C5	电子	72,328,037.81	7.18
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	192,038,243.18	19.07
C8	医药、生物制品	130,304,972.20	12.94
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	125,003,506.23	12.41
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,660.83	0.00
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	20,087,635.08	1.99
M	综合类	-	-
	合计	604,964,028.13	60.07

(三) 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明细 (单位: 元)

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	000338	潍柴动力	813,157	40,820,481.40	4.05
2	000063	中兴通讯	999,252	38,151,441.36	3.79
3	002215	诺普信	1,751,120	36,230,672.80	3.60
4	002148	北纬通信	1,355,021	35,162,794.95	3.49
5	600582	天地科技	1,359,353	34,024,605.59	3.38
6	000651	格力电器	1,397,244	30,459,919.20	3.02
7	600166	福田汽车	2,013,100	29,854,273.00	2.96
8	600176	中国玻纤	1,930,000	28,969,300.00	2.88
9	000963	华东医药	1,814,560	27,944,224.00	2.77
10	600196	复星医药	1,719,970	27,399,122.10	2.72

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

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	37,326,284.00	3.71
2	央行票据	111,304,000.00	11.05

3	金融债券	68,751,000.00	6.83
	其中：政策性金融债	68,751,000.00	6.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	547,367.40	0.05
7	其他	-	-
8	合计	217,928,651.40	21.64

(五) 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(单位:元)

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	0901036	09 央票 36	500,000	49,150,000.00	4.88
2	080311	08 进出 11	500,000	48,795,000.00	4.84
3	0801047	08 央票 47	200,000	20,736,000.00	2.06
4	0801035	08 央票 35	200,000	20,714,000.00	2.06
5	080225	08 国开 25	200,000	19,956,000.00	1.98

(六) 报告附注

1、根据中兴通讯股份有限公司董事会 2008 年 10 月 7 日《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》，中兴通讯在财政检查中受到 16 万元的行政罚款并被要求补缴企业所得税 380 万元。按照公司的《股票库管理办法》规定流程，在金融工程部和研究部详细研究基础上，经过公司内部审批流程，中兴通讯被加入本公司的优选股票库，并进行定期更新和日常维护，本公司对中兴通讯的投资决策程序符合法律法规及公司制度的规定。中兴通讯受到处罚的公告发布后，基金经理专门就此问题对该公司进行了调研，经公司投研晨会讨论，认为中兴通讯在会计处理中的确存在不妥当之处，但这对该公司的业绩影响非常小，而此次暴露出的问题将有助于该公司改善财务质量，长期看这对投资者有利，基金经理仍然看好中兴通讯的投资价值，决定继续持有。除了中兴通讯外，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产(单位:元)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,048,647.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,469,051.89

5	应收申购款	1,192,019.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,709,719.55

- 4、报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。
- 5、报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。
- 6、报告期末本基金未持有权证。
- 7、报告期末基金未持有资产支持证券。
- 8、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

合丰周期基金

(一) 报告期末基金资产组合 (单位: 元)

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	563,034,173.53	77.03
	其中: 股票	563,034,173.53	77.03
2	固定收益投资	152,065,924.00	20.81
	其中: 债券	152,065,924.00	20.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,096,067.42	1.65
6	其他资产	3,692,837.81	0.51
7	合计	730,889,002.76	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位: 元)

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	-	-
B	采掘业	17,810,000.00	2.46
C	制造业	408,209,355.93	56.37
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	94,151,503.40	13.00

C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	304,688,227.33	42.07
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	9,369,625.20	1.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	7,706,657.96	1.06
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	59,140,000.00	8.17
J	房地产业	58,264,159.64	8.05
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	11,904,000.00	1.64
	合计	563,034,173.53	77.75

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细 (单位: 元)

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	000157	中联重科	1,580,000	37,762,000.00	5.21
2	002146	荣盛发展	2,249,961	36,539,366.64	5.05
3	000425	徐工机械	1,099,948	35,308,330.80	4.88
4	002165	红宝丽	1,799,061	35,261,595.60	4.87
5	000338	潍柴动力	699,964	35,138,192.80	4.85
6	002206	海利得	1,349,957	34,288,907.80	4.73
7	601166	兴业银行	1,000,000	33,790,000.00	4.67
8	000651	格力电器	1,499,932	32,698,517.60	4.52
9	600166	福田汽车	2,199,886	32,624,309.38	4.51
10	000550	江铃汽车	1,699,943	30,853,965.45	4.26

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

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	31,327,924.00	4.33
2	央行票据	110,792,000.00	15.30
3	金融债券	9,946,000.00	1.37

	其中：政策性金融债	9,946,000.00	1.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	152,065,924.00	21.00

(五) 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(单位:元)

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	0901038	09 央票 38	600,000	58,974,000.00	8.14
2	0801047	08 央票 47	300,000	31,104,000.00	4.30
3	0801035	08 央票 35	200,000	20,714,000.00	2.86
4	030002	03 国债 02	200,000	20,174,000.00	2.79
5	080221	08 国开 21	100,000	9,946,000.00	1.37

(六) 报告附注

1. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2. 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,125,488.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,770,710.68
5	应收申购款	796,638.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,692,837.81

4. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

6. 报告期末基金未持有权证。

7. 报告期末基金未持有资产支持证券。

8. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

合丰稳定基金

(一) 报告期末基金资产组合 (单位: 元)

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	184,755,126.03	71.78
	其中: 股票	184,755,126.03	71.78
2	固定收益投资	52,666,212.00	20.46
	其中: 债券	52,666,212.00	20.46
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	18,303,371.58	7.11
6	其他资产	1,670,057.99	0.65
7	合计	257,394,767.60	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位: 元)

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	76,520,640.64	30.27
C0	食品、饮料	48,307,796.85	19.11
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	7,653,280.00	3.03
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	13,727,058.40	5.43
C8	医药、生物制品	6,832,505.39	2.70
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,341,766.70	0.53
H	批发和零售贸易	50,161,769.66	19.84

I	金融、保险业	56,730,949.03	22.44
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	184,755,126.03	73.09

(三) 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明细 (单位: 元)

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	000869	张裕A	183,787	11,302,900.50	4.47
2	601009	南京银行	624,999	11,024,982.36	4.36
3	600809	山西汾酒	365,735	10,975,707.35	4.34
4	600785	新华百货	423,394	10,792,313.06	4.27
5	002024	苏宁电器	645,927	10,586,743.53	4.19
6	601998	中信银行	1,848,000	10,385,760.00	4.11
7	601169	北京银行	583,929	10,061,096.67	3.98
8	000417	合肥百货	1,013,719	10,045,955.29	3.97
9	601628	中国人寿	360,000	9,964,800.00	3.94
10	000568	泸州老窖	322,445	9,479,883.00	3.75

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

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	12,298,212.00	4.87
2	央行票据	40,368,000.00	15.97
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	52,666,212.00	20.83

(五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 (单位: 元)

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	0801035	08 央票 35	200,000	20,714,000.00	8.19
2	0901044	09 央票 44	200,000	19,654,000.00	7.78

3	010308	03 国债(8)	81,530	8,185,612.00	3.24
4	010110	21 国债(10)	30,000	3,082,800.00	1.22
5	010112	21 国债(12)	10,000	1,029,800.00	0.41

(六) 报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产（单位：元）

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	853,913.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	531,978.35
5	应收申购款	284,166.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,670,057.99

4、报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

6、报告期末基金未持有权证。

7、报告期末基金未持有资产支持证券。

8、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

八、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。

本基金合同生效日为 2003 年 4 月 25 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

(一) 截止 2009 年 9 月 30 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

合丰成长基金

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
2003年4月25日 -12月31日	-1.41%	0.56%	-7.34%	0.78%	5.93%	-0.22%
2004年1月1日 -12月31日	17.09%	0.95%	-8.54%	1.02%	25.63%	-0.07%
2005年1月1日 -12月31日	11.42%	0.97%	-7.13%	0.98%	18.55%	-0.01%
2006年1月1日 -12月31日	81.74%	1.26%	54.13%	1.06%	27.61%	0.20%
2007年1月1日 -12月31日	110.40%	1.64%	81.63%	1.54%	28.77%	0.10%
2008年1月1日 -12月31日	-31.61%	1.83%	-34.32%	1.92%	2.71%	-0.09%
2009年1月1日-9 月30日	29.93%	1.33%	31.52%	1.25%	-1.59%	0.08%
基金合同生效以 来至2009年9月 30日	337.08%	1.32%	90.32%	1.30%	246.76%	0.02%

合丰周期基金

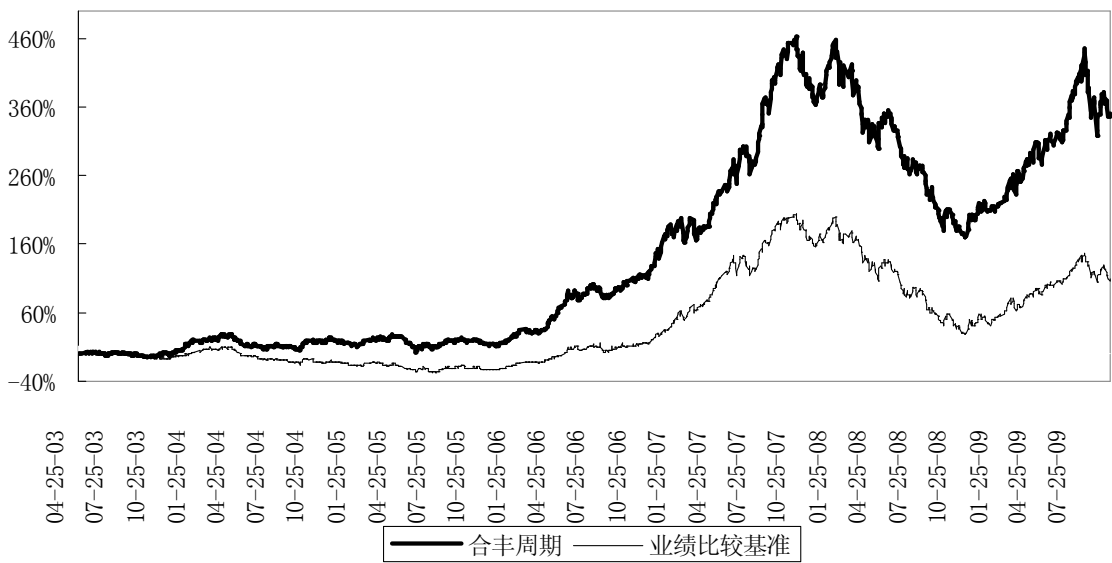
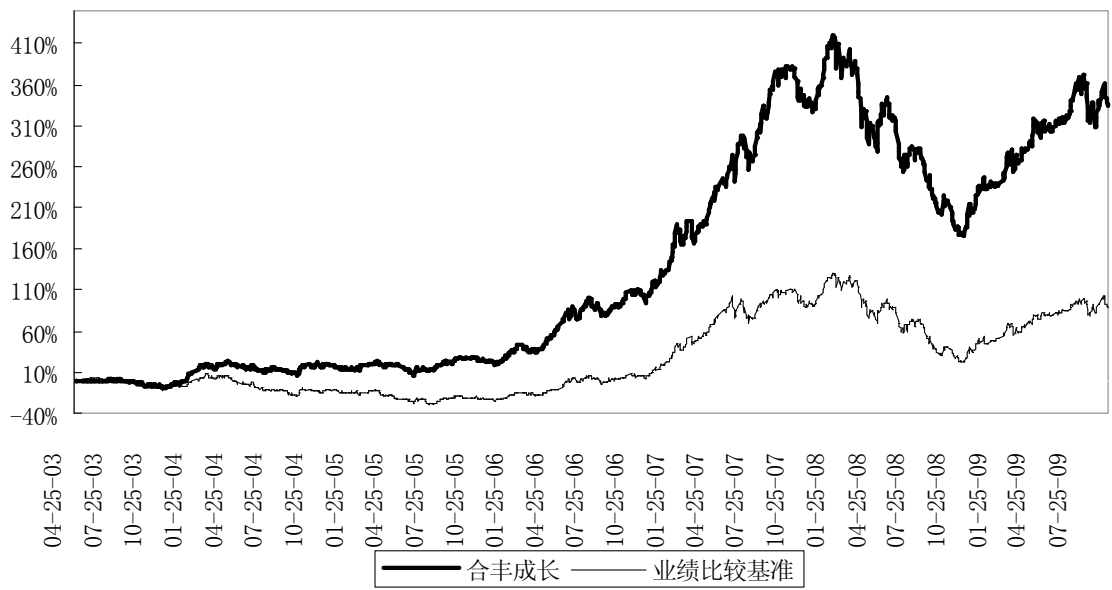
阶段	净值增长率 ①	净值增长率标 准差 ②	业绩比较基准 收益率 ③	业绩比较基准收 益率标准差 ④	①-③	②-④
2003年4月25日 -12月31日	11.98%	0.69%	-1.86%	0.64%	13.84%	0.05%
2004年1月1日- 12月31日	3.12%	1.08%	-14.31%	0.90%	17.43%	0.18%
2005年1月1日- 12月31日	3.87%	1.07%	-4.37%	0.99%	8.24%	0.08%
2006年1月1日- 12月31日	137.80%	1.29%	70.60%	1.37%	67.20%	-0.08%
2007年1月1日 -12月31日	81.77%	1.82%	105.32%	1.63%	-23.55%	0.19%
2008年1月1日 -12月31日	-40.52%	1.80%	-49.54%	2.01%	9.02%	-0.21%
2009年1月1日-9 月30日	46.16%	1.86%	47.52%	1.59%	-1.36%	0.27%

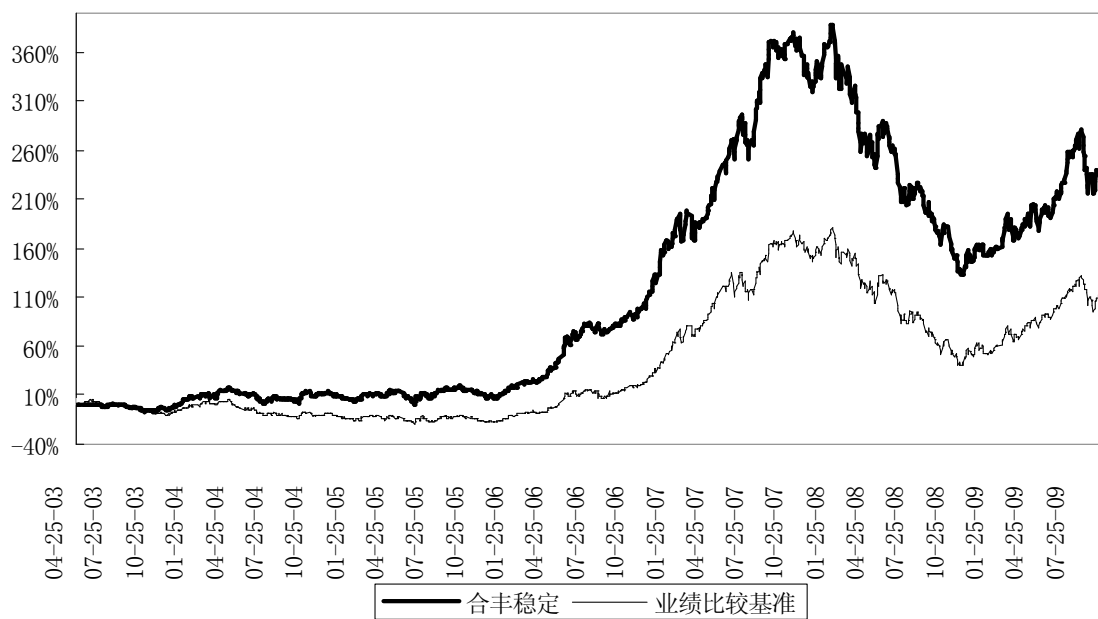
基金合同生效以来至 2009 年 9 月 30 日	350.69%	1.46%	109.68%	1.41%	241.01%	0.05%
---------------------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

合丰稳定基金

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
2003 年 4 月 25 日 -12 月 31 日	5.10%	0.55%	-3.70%	0.71%	8.80%	-0.16%
2004 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	1.82%	0.90%	-9.97%	0.84%	11.79%	0.06%
2005 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	6.52%	0.97%	-0.36%	0.86%	6.88%	0.11%
2006 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	135.33%	1.19%	76.12%	1.11%	59.21%	0.08%
2007 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	74.10%	1.61%	76.76%	1.45%	-2.66%	0.16%
2008 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	-46.00%	1.79%	-43.98%	1.89%	-2.02%	-0.10%
2009 年 1 月 1 日-9 月 30 日	31.22%	1.55%	35.12%	1.32%	-3.90%	0.23%
基金合同生效以 来至 2009 年 9 月 30 日	230.96%	1.32%	103.58%	1.26%	127.38%	0.06%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动比较图





九、基金的财产

（一）基金财产总值

本基金财产总值是指本基金购买各类有价证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资形成的价值的总和。

（二）基金财产净值

基金财产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的帐户

基金托管人代表本基金，以托管人和本基金联名的方式开立证券帐户，以本基金名义在托管银行开立银行存款帐户并报中国证监会备案。基金托管人以自身名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。本基金帐户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构、基金注册登记机构自有资产帐户以及其他基金财产帐户相独立。

（四）基金财产的保管与处分

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

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

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

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

除依据法律法规、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

十、基金资产的估值

(一) 本系列基金中各行业类别基金分别进行基金资产估值。

(二) 估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

(三) 估值日

本系列基金的估值日为基金合同生效后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。

(四) 估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

(五) 估值方法

(1) 股票估值方法

1) 上市流通股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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值;

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时,应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值:

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
 (FV 为估值日该非公开发行股票的价值; C 为该非公开发行股票初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时,应于除权日对其初始取得的成本作相应调整); P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价; D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数; Dr 为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数,不含估值日当天)。

3) 对旗下基金持有长期停牌股票采用指数收益法进行估值,即以上海证券交易所和深圳证券交易所公开发布的相应行业指数的日收益率作为该类股票的收益率,根据该收益率计算股票当日的公允价值。

4) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(2) 债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日无交易的,但最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的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,估值日无交易的,但最近交易日后经济环境未发生重大变化的,按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价(净价)及重大变化因素,调整最近交易日收盘价(净价),确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价(净价)不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整,确定公允价值进行估值。

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

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

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) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(3) 权证估值方法

1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(4) 资产支持证券的估值方法

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

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 股票指数期货合约的估值方法：

1) 股票指数期货合约以结算价格进行估值。

2) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（6）其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，共同查明原因，双方协商解决。以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，本系列基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本系列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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

（六）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。

（七）暂停估值的情形

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

（八）基金份额净值的计算

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金总份额余额

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（九）估值错误的处理

（1）当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误实际发生时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本系列基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

（2）差错类型

本系列基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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。

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无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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。

（3）差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本系列基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失有

差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

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

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

4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

5) 如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，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、本系列基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管人有权向出现差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。

(4) 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，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

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人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，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计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应

当公告，并报中国证监会备案。

（十）特殊情形的处理

（1）基金管理人按本条第（五）项第（7）条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

（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，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，由此造成的基金财产估值错误，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。

十一、基金的收益和分配

（一）基金收益的构成

- 1、各行业类别基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、各行业类别基金买卖证券价差；
- 3、各行业类别基金银行存款利息；
- 4、其他收入。

因运用各行业类别基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

（二）基金净收益

各行业类别基金净收益为各行业类别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）基金收益分配原则

- 1、各行业类别基金收益独立分配，即单独决定收益分配方案；
- 2、各行业类别基金收益分配比例不低于该基金会计年度净收益的 90%；
- 3、根据自身情况，在符合有关基金分红条件的前提下，各行业类别基金收益每年至少分配一次；
- 4、各行业类别基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 5、各行业类别基金投资当期亏损，则不进行收益分配；
- 6、同一行业类别基金中每一基金份额享有同等分配权；
- 7、基金份额持有人默认的分红方式为现金分红；
- 8、上述规定若根据国家法律、法规以及中国证监会规定发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金收益分配方案

每只行业类别基金收益分配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）基金收益分配方案的确定与公告

每只行业类别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，在报中国证监会备案后五个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

十二、基金的费用与税收

(一) 本系列基金发生的费用按照公平原则经托管人认定后由各行业类别基金单独承担或由各行业类别基金分摊。

(二) 基金运作费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金证券交易费用；
- 4、基金的信息披露费用；
- 5、基金的会计师费和律师费；
- 6、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

各行业类别基金费用由基金托管人从该基金资产中支付。

(三) 基金运作费用计提方法、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，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的本系列基金管理费；

E：为前一日各行业类别基金资产净值的和。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从各行业类别基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H：为每日应支付的本系列基金托管费；

E：为前一日的本系列基金各行业类别基金资产净值的和。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，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。

3、上述（二）基金费用第3—6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，由基金托管人从本系列基金每只行业类别基金资产中支付。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以调低基金管理人的管理费及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

（四）申购、赎回的费用和基金间转换的费用

1、申购费

申购费率如下：

申购金额（M）	费率
M<50万	1.50%
50万≤M<250万	1.20%
250万≤M<500万	0.75%
500万≤M<1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

2、赎回费

赎回费率如下：

连续持有期限（日历日）	适用的赎回费率
1天—365天	0.5%
366天（含）—730天	0.25%
731天（含）以上	0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本系列基金任意一子基金连续持有期限超过365天，赎回费率为0.25%；连续持有期限超过730天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的25%划归基金资产。

3、基金间转换费

- (1) 本系列基金之间转换不收费；
- (2) 本系列基金、荷银预算、荷银精选基金转换费为0.25%；
- (3) 荷银货币基金与本系列基金之间转换：

A、由荷银货币基金转入本系列基金，转换费率按如下方式确定：

适用于认购期间购买的荷银货币基金份额：

基金份额持有时间	转换费率
1天~90天	本系列基金的申购费率
91天(含)以上	0

适用于申购期间购买的荷银货币基金份额：

基金份额持有时间	转换费率
1天~90天	本系列基金的申购费率
91天(含)~365天	本系列基金的申购费率-0.25%
366天(含)~730天	本系列基金的申购费率-0.5%
731天(含)以上	0

B、由本系列基金转出至荷银货币基金，转换费率为转换申请日的本系列基金所适用的赎回费率。

- (4) 荷银首选基金、荷银市值基金与本系列基金之间的转换：

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。基金转换费用中的赎回费的25%归入基金资产。具体公式如下：

$$\text{转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金当日基金单位资产净值}$$

转换费用：

如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率，

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率 + 转出金额 × 转出基金与转入基金的申购费率差

如果转出基金的申购费率 > 转入基金的申购费率，

$$\text{转换费用} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

转入金额 = 转出金额 - 转换费用

转入份额 = 转入金额 ÷ 转入基金当日基金单位资产净值

(5) 本公司可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同规定的前提下，在与托管银行和代销机构协商一致后对上述收费方式和费率进行调整，但最迟应于调整后的收费方式和费率实施前 2 个工作日在指定媒体上公告。

(五) 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本系列基金资产的损失，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。

(六) 基金税收

本系列基金每只行业类别基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十三、基金的会计与审计

(一) 本系列基金各行业类别基金的会计与审计独立进行。

(二) 基金会计政策

1、本系列基金每只行业类别基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

2、本系列基金每只行业类别基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；

3、会计制度执行国家有关会计制度；

4、各行业类别基金独立建帐、独立核算；

5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制各行业类别基金会计报表；

6、基金托管人每日与基金管理人就各行业类别基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

(三) 基金审计

1、本系列基金管理人聘请具有证券业从业资格的会计师事务所及其注册会计师对各行业类别基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金发起人、基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须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，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在5个工作日内公告。

十四、基金的信息披露

（一）基金信息披露的原则

本基金的信息披露应符合《基金法》、《信息披露办法》、本基金合同及其他有关规定。基金信息披露义务人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人和互联网网站等媒介披露，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。

（二）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定编制，由基金托管人复核。基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告。

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

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

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

（三）基金份额净值及基金份额累计净值公告

每开放日的次日披露该开放日基金份额净值和基金份额累计净值。并在半年度和年度最后一个市场交易日的次日公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。

（四）临时报告与公告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、基金管理人或基金托管人变更；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员一年内变更达 30%以上；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、开始办理申购、赎回和基金间转换业务；
- 22、基金申购、赎回、基金间转换费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并顺延支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回和基金间转换申请；
- 25、其它暂停基金申购、赎回和基金间转换的情形；
- 26、暂停后重新接受基金申购、赎回和基金间转换的情形；
- 27、证监会规定的其他重大事项。

（五）澄清公告与说明

在基金合同期限内，任何公共传播媒介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引起较大波动时，相关的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）信息披露事务管理

1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息披露事务。

2、基金托管人须对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关信息进行复核、审查，并就此向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

3、本基金的基金合同、招募说明书、更新招募说明书等公告文本在编制完成后，应存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、基金注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

十五、风险揭示

本系列基金存在的主要风险有：

（一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

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

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

（二）管理风险

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

（三）流动性风险

本系列基金属于开放式系列基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于开放式系列基金在国内是首次推出，应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

（四）主管部门或权威机构行业划分规定发生变化时，行业类别基金投资范围发生变化所可能产生的风险

主管部门或权威机构未来行业划分规则可能发生变化，这种情况可能导致本系列基金管理人对各行业必须重新归类，造成本系列基金行业类别中原行业归类发生改变。投资者购买本系列基金可能面临由于这种归类的变化所带来的相应行业类别基金投资范围发生改变的风险。

除非主管部门或权威机构的行业划分规则发生改变，本系列基金管理人不会主动改变本系列基金的行业归类。

（五）本系列基金各只行业类别基金间转换所产生的风险

本系列基金各行业类别基金可免费在基金间转换。由于基金间免费转换的实施，可能使相关的行业类别基金的规模发生较大改变，从而对转出和转入基金的原持有人利益产生影响。

（六）本系列基金某只行业类别基金终止对基金间转换选择带来的风险

由于三只行业类别基金可以分别终止，某只行业类别基金终止，可能导致本系列基金产品结构发生改变，从而使基金份额持有人的基金间转换选择受到影响。

（七）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

十六、基金的终止与清算

（一）基金的终止

在本系列基金的存续期内，出现下列情形之一时，某只行业类别基金经中国证监会批准后将终止：

- 1、存续期内，某只行业类别基金有效持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日该基金资产净值低于5000万元人民币，并经基金管理人宣布终止该基金；
- 2、因重大违法、违规行为，某只行业类别基金被中国证监会责令终止；
- 3、某只行业类别基金经持有人大会表决终止；
- 4、法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

出现下列情形之一时，本系列基金经中国证监会批准后将终止：

- 1、因上述原因三只行业类别基金均被终止；
- 2、因重大违法、违规行为，本系列基金被中国证监会责令终止；
- 3、本系列基金经持有人大会表决终止；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，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、法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照本系列基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（二）基金清算小组

1、本系列基金或某只行业类别基金终止之日起30个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对终止后的每只行业类别基金分别进行基金清算。

2、基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在该基金终止之日起15个工作日内将本方参

加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

3、基金清算小组接管基金资产后，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进行必要的民事活动。

（三）基金清算小组的工作内容

- 1、本系列基金或某只行业类别基金终止后，发布基金清算公告；
- 2、基金清算小组统一接管终止后的每只行业类别基金资产；
- 3、对终止后的每只行业类别基金资产分别进行清理和确认；
- 4、对终止后的每只行业类别基金资产分别进行估价；
- 5、对基金资产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- 8、公布终止后的每只行业类别基金清算结果公告；
- 9、进行终止后的每只行业类别基金剩余资产的分配。

（四）清算费用

清算费用是指清算小组在进行本系列基金或某只行业类别基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从终止的各只行业类别基金资产中分别支付。

（五）基金资产按下列顺序清偿

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿终止后的每只行业类别基金债务；
- 4、按终止后的每只行业类别基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

该基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给该基金份额持有人。

（六）基金清算的公告

某只行业类别基金清算公告于该基金终止并报中国证监会备案后5个工作日内公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；该基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后在3个工作日内公告。

（七）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。

十七、基金合同内容摘要

（一）基金份额持有人的权利和义务

基金投资者购买本系列基金份额的行为即视为对本系列基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据本系列基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和本系列基金合同的当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在本系列基金合同上的书面签章为必要条件。

1、基金份额持有人权利

（1）按照本系列基金合同的规定提议召开及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）监督基金运作情况；

（4）按本系列基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务和基金财务状况资料；

（5）按照本系列基金合同的规定申购、赎回或基金间转换基金份额；

（6）参与基金清算后剩余资产的分配；

（7）要求基金管理人或基金托管人履行本系列基金合同规定的义务；

（8）法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

（1）遵守本系列基金合同；

（2）缴纳基金认购、申购款项及按照规定支付相应费用；

（3）承担持有基金亏损或者终止的有限责任；

（4）不从事任何有损本系列基金及本系列基金其他当事人利益的活动；

（5）法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

(1) 自基金合同生效之日起，依法并依照本系列基金合同的规定独立运用并管理基金资产；

(2) 依照本系列基金合同获得基金管理费及其他约定和法定的收入；

(3) 依据本系列基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本系列基金合同或国家有关法律的规定，致使基金资产或基金份额持有人利益产生重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；

(4) 销售基金份额，获得认购、申购和基金间转换费用；

(5) 提议召开基金份额持有人大会；

(6) 代表基金对其所投资的企业依法行使股东权利；

(7) 行使因投资于其它证券所产生的权利；

(8) 担任注册登记机构或委托其他机构担任注册登记机构或更换注册登记机构；

(9) 委托和更换基金代销机构，并对基金代销机构的代销行为进行监督；

(10) 在本系列基金合同规定的情形出现时，决定暂停受理基金份额的申购、赎回和基金间转换；

(11) 决定基金收益的分配方案；

(12) 根据本系列基金合同的规定提名新基金托管人；

(13) 于基金终止时，组建或参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(14) 有关法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 遵守本系列基金合同；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产；

(3) 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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和基金间转换业务或委托其他机构代理该项业务；

(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；

(7) 确保所管理的基金资产和基金管理人的自有资产相互独立，确保所管理的每只行业类别基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(8) 除法律、法规、规章和本合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人运作基金资产；

(9) 依法接受基金托管人的依法监督；

(10) 按规定计算并公告各行业类别基金资产净值及各行业类别基金份额净值；

(11) 按照《基金法》、本系列基金合同及其他有关规定，履行信息披露和报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及本合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(13) 按约定向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按约定受理申购、赎回和基金间转换申请，及时、足额支付赎回款项和转换后的基金份额；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(16) 依照本系列基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

(17) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(18) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；并且保证投资人能够按照招募说明书规定的时间和方式，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；

(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) 当面临解散、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；

(21) 因过错导致基金资产的损失，应采取适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

(22) 因估值错误导致投资人的损失，应采取适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

(23) 不从事任何有损本系列基金及本系列基金其他当事人利益的活动；

(24) 有关法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金资产；
- (2) 依照本系列基金合同的规定，获取基金托管费；
- (3) 依法监督基金的投资运作；
- (4) 根据本系列基金合同的规定提名新基金管理人；
- (5) 法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 遵守本系列基金合同，依法持有基金资产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金的全部资产；
- (3) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够、合格的熟悉基金托管业务专职人员从事基金资产托管事宜；
- (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行业类别基金资产相互独立；对每只行业类别基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同行业类别基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (5) 除法律、法规、规章及本系列基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转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) 以各行业类别基金的名义分别开立证券账户、银行账户等基金资产账户，严格执行基金管理人的投资指令，认真办理基金投资于证券的清算交割及基金名下的资金往来；
- (8) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及本合同另有规定外，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各行业类别基金资产净值或各行业类别基金份额净值；
- (10) 采取适当、合理的措施使开放式基金份额的认购、申购、赎回和基金间转换等事项符合本系列基金合同等有关法律文件规定；
- (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的认购、申购、赎回、基金间转换的方法符合本系列基金合同等有关法律文件规定；

(12) 采取适当、合理的措施使基金投资和融资的条件符合本系列基金合同等有关法律文件规定；

(13) 按规定出具各行业类别基金业绩和各行业类别基金托管情况的报告，并报中国银监会和中国证监会；

(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合同的规定进行，如果基金管理人未执行本系列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) 建立并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及时核对；

(18) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金收益和赎回款项支付到专用账户；

(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银监会，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) 监督基金管理人按本系列基金合同的规定履行自己的义务，因基金管理人过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(23) 有关法律、法规、规章和本系列基金合同规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

2、召开事由

本系列基金份额持有人大会召开事由分为共同事由和单独事由。有以下共同事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；

(2) 决定终止本系列基金；

(3) 更换基金管理人；

(4) 更换基金托管人；

(5) 本系列基金与本系列基金以外的其他基金合并；

(6) 单独或合计持有本系列基金 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就涉及本系列基金的同一共同事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(7) 基金管理人或基金托管人就涉及本系列基金的共同事宜要求召开基金份额持有人大会；

(8) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(9) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

3、有以下单独事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会

(1) 决定终止本系列基金中某只行业类别基金；

(2) 单独或合计持有本系列基金某只行业类别基金 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就该行业类别基金的同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(3) 基金管理人或基金托管人就仅涉及某只行业类别基金的事宜要求召开基金份额持有人大会；

(4) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

4、召集方式

(1) 正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会的时间及地点由基金管理人确定；

(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，应当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，应当自行召集；

(3) 单独或者合并持有基金份额百分之十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（单独或合计持有本系列某只行业类别基金 10%以上基金份额的持有人有权以书面方式说明提议单独事项及理由）。基金管理人应当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，应当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，代表基金份额百分之十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，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，单独或者合并持有基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

6、召开方式

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本系列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。

召开基金份额持有人大会的条件：

召开基金份额持有人大会的条件适用于就共同事由和单独事由召开的基金份额持有人大会。召开基金份额持有人大会的条件中，就共同事由召开的基金份额持有人大会，基金总份额指本系列基金的基金总份额。就单独事由召开的基金份额持有人大会，基金总份额指涉及该单项事由的某只行业类别基金的基金总份额。

(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，所代表的有效的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

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、法规和规章、本系列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(1)的条件情况下，则召集人应当将会议至少推迟 15 个工作日后重新召集，并公告重新开会的时间和地点，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。重新以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

①亲自出席会议者持有基金份额的凭证、代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书均符合法律、法规、本系列基金合同和会议通知的规定；

②对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，所代表的有效的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

(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权益登记日基金总份额 50%以上，基金份额持有人或其代理人在表决截止日前(含当日)以书面方式进行表决(以收到书面表决材料的日期为准)。

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。代理人在通讯方式开会中进行表决时，应向召集人同时提交有关基金份额持有人出具的有效授权委托书；

②参加表决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并符合有关法律、法规和规章、本系列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；

③基金管理人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

④会议通知公布前报中国证监会备案。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人应当将会议至少推迟15个工作日后重新召集,并公告重新表决的时间,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。重新以通讯开会方式再次召集基金份额持有人大会的,必须同时符合以下条件:

①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权益登记日基金总份额的50%以上;

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、法规和规章、本系列基金合同的规定;

③基金管理人按本系列基金合同规定公布会议通知后,在2日内连续公布相关提示性公告;

④基金管理人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;会议通知公布前已报中国证监会备案。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

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。

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有本系列基金10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(单独或合计持有本系列基金某只行业类别基金10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人)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共同事由(单独事由)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,临时提案最迟应当在大会召开日前15日提交召集人;召集人对于临时提案应当最迟在大会召开日前10日公告。

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修改,应当最迟在基金份额持有人大会召开日前10日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有10日的间隔期。

(2) 议事程序

现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）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。

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 20 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。

8、表决

基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

对共同事由的一般决议须经出席会议的每只行业类别基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上都通过方为有效；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。

对单独事由的一般决议须经出席会议的涉及该单项事由的该只行业类别基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上都通过方为有效；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

对共同事由的特别决议须经代表权益登记日每只行业类别基金总份额的三分之二以上的基金份额持有人都通过方可作出；涉及转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同的共同事由则必须以特别决议的方式通过方为有效。

对单独事由的特别决议须经涉及该单项事由的每只行业类别基金总份额的三分

之二以上的基金份额持有人都通过方可作出；涉及决定本系列基金某只行业类别基金终止必须以特别决议的方式通过方为有效。

(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应当分开审议、逐项表决。

9、计票

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并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者代理人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。

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。

10、生效与公告

基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内由召集人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。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起5个工作日内在至少一种中国证监会指定

的信息披露媒体公告。

（五）基金的终止与清算

1、基金的终止

在本系列基金的存续期内，出现下列情形之一时，某只行业类别基金经中国证监会批准后将终止：

（1）存续期内，某只行业类别基金有效持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日该基金资产净值低于5000万元人民币，并经基金管理人宣布终止该基金；

（2）因重大违法、违规行为，某只行业类别基金被中国证监会责令终止；

（3）某只行业类别基金经持有人大会表决终止；

（4）法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

出现下列情形之一时，本系列基金经中国证监会批准后将终止：

（1）因上述原因三只行业类别基金均被终止；

（2）因重大违法、违规行为，本系列基金被中国证监会责令终止；

（3）本系列基金经持有人大会表决终止；

（4）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，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）法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照本系列基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

2、基金清算小组

（1）本系列基金或某只行业类别基金终止之日起30个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对终止后的每只行业类别基金分别进行基金清算。

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册

会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在该基金终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

(3) 基金清算小组接管基金资产后，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进行必要的民事活动。

3、基金清算小组的工作内容

- (1) 本系列基金或某只行业类别基金终止后，发布基金清算公告；
- (2) 基金清算小组统一接管终止后的每只行业类别基金资产；
- (3) 对终止后的每只行业类别基金资产分别进行清理和确认；
- (4) 对终止后的每只行业类别基金资产分别进行估价；
- (5) 对基金资产进行变现；
- (6) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (7) 以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- (8) 公布终止后的每只行业类别基金清算结果公告；
- (9) 进行终止后的每只行业类别基金剩余资产的分配。

4、清算费用

清算费用是指清算小组在进行本系列基金或某只行业类别基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从终止的各只行业类别基金资产中分别支付。

5、基金资产按下列顺序清偿

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿终止后的每只行业类别基金债务；
- (4) 按终止后的每只行业类别基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

该基金资产未按前款(1)至(3)项规定清偿前，不分配给该基金份额持有人。

6、基金清算的公告

某只行业类别基金清算公告于该基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内公

告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；该基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后在 3 个工作日内公告。

（六）争议的解决

对于因本协议的订立、内容、履行和解释或与本协议有关的争议，本系列基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

（七）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得基金合同的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

十八、基金托管协议的内容摘要

(一) 托管协议当事人

1、基金管理人：泰达荷银基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

注册资本：1.8亿元人民币

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

基金托管人名称：交通银行

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：蒋超良

注册资本：人民币489.94亿元

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；基金托管业务。

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

(二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

(1) 监督和核查内容

根据《基金法》、《基金合同》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购、赎回与转换、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（2）处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》和《基金合同》和有关证券法规规定的行为，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对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

（1）监督和核查内容

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、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（2）处理方式和程序

基金管理人定期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、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人对于基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对于基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

3、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。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提

出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

（三）基金资产的保管

1、基金资产保管的原则

本系列基金所有资产的保管责任，由基金托管人承担。

基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人要为本系列基金的三个基金分别开立三个独立的帐户，每个基金的资金都要分别保管。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2、基金的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承担。

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

（3）本系列基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用，基金托管人根据基金管理人的指令或授权，办理资金的收支。

（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有关规定》、《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。

3、基金证券账户和资金账户的开设和管理

（1）基金托管人以本系列基金的三个子基金的名义分别在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设证券账户。

（2）基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本系列基金业务的需要。基金托管人和基金管理人均不得将证券帐户出借与转让，亦不得使用本系列基金的证券账户进行本系列基金业务以外的活动。

（3）基金托管人以本系列基金的三个子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和中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立基金证券交易资

金清算账户，用于证券交易的资金清算。

(4) 如因中国证券登记结算公司帐户管理制度发生变化，要求由基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算公司开设资金清算专户并对各基金进行二级清算的，基金管理人与基金托管人约定如下：

1) 因基金管理人管理不善造成基金交易透支，基金管理人应立即通过卖出证券、回购等方式及时补足头寸，并承担因透支而造成的利息损失和罚款等经济责任。

2) 如果基金管理人在资金交收日无法及时补足头寸，托管人有权在次日向证券登记结算公司提出申请，暂扣相应基金证券帐户内相当于透支金额 120%的指定证券。若在两个交易日内不能弥补透支，则由登记结算公司卖出所扣证券，补足清算备付金头寸。

3) 基金托管人有权根据基金管理人发生基金交易透支的情况，调整基金最低清算备付金金额。

4) 基金托管人有权将基金管理人的透支情况报告中国证监会。

4、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。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。

5、与基金财产有关的重大合同的保管

(1) 基金管理人代表基金签署并保管基金投资运作中的各类合同，基金管理人签署相关业务合同后应及时书面通知基金托管人。

(2) 基金管理人或基金托管人代表基金签署除基金投资运作外的但与基金资产有关的合同时，应通知对方并得到对方书面认可后方可签署。除基金投资运作外的、与基金资产有关的合同由基金托管人保管。

(四) 基金资产净值计算与会计复核

1、基金资产净值的计算和复核

(1) 本系列基金三只行业类别基金资产净值独立计算，每只行业类别基金资产净值是指该基金资产总值减去按照国家有关规定可以在该基金资产中扣除的费用及

基金负债后的价值。

(2) 基金管理人和基金托管人均应每日对基金资产估值。

(3) 基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。

(4) 基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人公布基金净值。

(5) 根据相关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本系列基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，则按基金会计责任方的建议执行。

2、基金账册的建账和对账

(1) 基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。

(2) 经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

3、基金财务报表与报告的编制和复核

(1) 基金财务报表由相应的基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 日内完成；季度报告在本基金合同生效后每季度公告一次，在该等期间届满后 15 个工作日内公告；更新招募说明书在本基金合同生效后每六个月公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。半年度报告在上半年终了后 40 日内编制完毕并于上半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

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

(3) 基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，该基金的基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以该基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

(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，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金管理人从过户与注册登记机构处取得，并负责保管。

(六) 争议解决方式

1、双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，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。

2、争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

(七) 托管协议的修改和终止

1、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。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

(1) 基金或《基金合同》终止；

(2) 因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本系列基金更换基金托管人；

(3) 因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本系列基金更换基金管理人；

(4) 发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

十九、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）资料寄送

1、基金投资人交易资料的对账服务

每次交易结束后，基金份额持有人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内按基金份额持有人的意愿向有交易的基金份额持有人以书面形式寄送季度对帐单，在每年度结束后 15 个工作日内按基金份额持有人意愿对所有基金份额持有人以书面形式寄送年度对帐单。

2、其它相关的信息资料

（二）红利再投资

本系列基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本系列基金，注册登记机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

（三）基金间转换

指本系列基金存续期间，基金管理人接受本系列基金份额持有人的申请，在本系列基金和基金管理人管理的其他基金范围内将其持有的某只行业类别基金份额转换为其它行业类别基金份额或基金管理人管理的其他基金的行为。

（四）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以定时定额申购基金份额。

详见“泰达荷银合丰系列基金定期定额投资计划公告”。

（五）在线服务

基金管理人利用自己的网站<http://www.aateda.com>定期或不定期为基金投资者提供各行业类别基金的投资策略分析报告、基金月度报告以及与基金经理（或投资顾问）交流的服务。

（六）网上开户与交易服务

目前，本基金的网上开户、交易功能可以通过以下途径实现：持有农业银行卡、

建设银行卡、兴业银行卡、浦发银行卡、中信银行卡、光大银行卡、招商银行卡、民生银行卡的客户，可通过基金管理人的网站（<http://www.aateda.com>）网上基金直销交易系统开户与交易。

基金管理人决定对通过本公司网上基金直销交易系统申购本公司旗下基金的客户实行优惠申购费率。

上述具体详情请查看公司网站或相关公告。

（七）资讯服务

泰达荷银客服中心为投资者提供 7*24 小时的电话语音服务，投资者可通过客服电话 400 698 8888（免长话费）或 010—66555662 的语音系统或登录公司网站 www.aateda.com，查询基金净值、基金帐户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间还将为您提供周到的人工答疑服务。

（八）投诉受理

投资人可以拨打泰达荷银基金管理有限公司客户服务中心电话400 698 8888（免长话费）或010—66555662投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

二十、其他应披露事项

1. 本基金管理人已于 2009 年 5 月 4 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于参加中国银行网上交易申购费率优惠的公告》。

2. 本基金管理人已于 2009 年 5 月 23 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。

3. 本基金管理人已于 2009 年 6 月 1 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于参加中国工商银行“基金定投 伴你‘童’行”营销活动的公告》。

4. 本基金管理人已于 2009 年 6 月 9 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于旗下部分基金参与兴业银行基金定投申购费率优惠活动的公告》。

5. 本基金管理人已于 2009 年 6 月 13 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。

6. 本基金管理人已于 2009 年 6 月 19 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于推出直销网上交易定期不定额投资业务的公告》。

7. 本基金管理人已于 2009 年 7 月 20 日发布《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金 2009 年度第 2 季度报告》。

8. 本基金管理人已于 2009 年 7 月 20 日发布《泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金 2009 年度第 2 季度报告》。

9. 本基金管理人已于 2009 年 7 月 20 日发布《泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金 2009 年度第 2 季度报告》。

10. 本基金管理人已于 2009 年 7 月 31 日发布《泰达荷银基金管理有限公司增加宏源证券股份有限公司为代销机构的公告》。

11. 本基金管理人已于 2009 年 7 月 31 日发布《泰达荷银基金管理有限公司旗下部分基金增加东海证券有限责任公司为代销机构的公告》。

12. 本基金管理人已于 2009 年 8 月 25 日发布《泰达荷银价值优化型成长行业证券投资基金 2009 年半年度报告》。

13. 本基金管理人已于 2009 年 8 月 25 日发布《泰达荷银价值优化型周期行业证券投资基金 2009 年半年度报告》。

14. 本基金管理人已于 2009 年 8 月 25 日发布《泰达荷银价值优化型稳定行业

证券投资基金 2009 年半年度报告》。

15. 本基金管理人已于 2009 年 8 月 28 日发布《泰达荷银基金管理有限公司增加长江证券股份有限公司为代销机构的公告》。

16. 本基金管理人已于 2009 年 9 月 7 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于参加中国农业银行网上交易申购费率优惠的公告》。

17. 本基金管理人已于 2009 年 9 月 30 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资创业板上市证券的提示性公告》。

18. 本基金管理人已于 2009 年 10 月 20 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于推出直销网上交易多卡交易业务的公告》。

上述公告的详细内容请参见当日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 www.aateda.com。

二十一、招募说明书存放及查阅方式

存放地点：基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构的住所。

查阅方式：投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆基金管理人互联网网址（<http://www.aateda.com>）查阅。

二十二、备查文件

本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资人也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.aateda.com>）查阅。

泰达荷银基金管理有限公司

2009年12月9日