

# 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书

(2010 年第 1 号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**



## 重要提示

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经 2009 年 8 月 31 日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】879 号文核准募集。本基金的基金合同于 2009 年 10 月 30 日正式生效。本基金类型为上市契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2010 年 4 月 30 日，有关财务数据和净值表

现截止日为 2010 年 3 月 31 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目录

第一节	绪言	5-1-1
第二节	释义	5-2-1
第三节	基金管理人	5-3-1
第四节	基金托管人	5-4-1
第五节	相关服务机构	5-5-1
第六节	基金的募集	5-6-1
第七节	基金合同的生效	5-7-1
第八节	基金份额的上市交易	5-8-1
第九节	基金份额的申购与赎回	5-9-1
第十节	基金的转换	5-10-1
第十一节	基金的非交易过户与转托管	5-11-1
第十二节	基金的投资	5-12-1
第十三节	基金的业绩	5-13-1
第十四节	基金的财产	5-14-1
第十五节	基金资产的估值	5-15-1
第十六节	基金的收益与分配	5-16-1
第十七节	基金的费用和税收	5-17-1
第十八节	基金的会计与审计	5-18-1
第十九节	基金的信息披露	5-19-1
第二十节	风险揭示	5-20-1
第二十一节	基金的终止和清算	5-21-1
第二十二节	基金合同的内容摘要	5-22-1
第二十三节	基金托管协议的内容摘要	5-23-1
第二十四节	对基金份额持有人的服务	5-24-1
第二十五节	其他披露事项	5-25-1
第二十六节	基金管理人和基金托管人的更换	5-26-1
第二十七节	招募说明书的存放及查阅方式	5-27-1
第二十八节	备查文件	5-28-1

## 第一节 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》）及其他有关规定以及《海富通中证 100 指数证券投资基金基金（LOF）合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

<b>基金或本基金：</b>	指海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）；
<b>基金合同：</b>	指《海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》及其的任何有效修订和补充；
<b>招募说明书：</b>	指《海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新；
<b>托管协议：</b>	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
<b>基金份额发售公告：</b>	指《海富通中证 100 指数证券投资基金基金（LOF）份额发售公告》；
<b>中国证监会：</b>	指中国证券监督管理委员会；
<b>中国银监会：</b>	指中国银行业监督管理委员会；
<b>银行业监督管理机构：</b>	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；
<b>《证券法》：</b>	指《中华人民共和国证券法》；
<b>《合同法》：</b>	指《中华人民共和国合同法》；
<b>《基金法》：</b>	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》；
<b>《运作办法》：</b>	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》；
<b>《销售办法》：</b>	指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》；
<b>《信息披露办法》：</b>	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》；
<b>《业务规则》：</b>	指《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

- 元：**指人民币元；
- 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，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
- 基金管理人：**指海富通基金管理有限公司；
- 基金托管人：**指中国银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：**指依基金合同合法取得基金份额的投资者；
- 注册登记业务：**指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记机构：**指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。对于投资者通过销售机构提交的基金交易业务申请（包括基金认购、申购、赎回、转换、转托管、分红方式设置等），其最终处理结果以注册登记机构的确认为准。
- 注册登记系统：**指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统；
- 投资者：**指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称；
- 个人投资者：**指依据中国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：**指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者：**指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中

- 国境内证券市场的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人大会：**指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
- 基金募集期：**指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月；
- 基金合同生效日：**指基金募集达到法律规定及基金合同规定的条件，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理基金备案手续，证监会书面确认的日期；
- 基金合同终止日：**指基金合同规定的合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期；
- 存续期：**指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 认购：**指在基金募集期间，投资者申请购买基金份额的行为；
- 申购：**指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为；
- 赎回：**指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为；
- 巨额赎回：**指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回；
- 上市交易：**基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
- 日常交易：**指场外申购和赎回等场外基金交易，以及场内申购和赎回及上市交易等场内基金交易；
- 基金转换：**指基金份额持有人按基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、由

- 同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为；
- 投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 基金销售：**指对基金申购、赎回、转换等业务(不包括交易)的统称；
- 场内：**指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的深圳证券交易所会员单位和场所
- 场外：**指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的销售机构和场所
- 基金销售网点：**指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点；
- 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；
- 证券账户：**指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户，投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、申购、赎回等业务时需持有深圳证券账户；
- 开放式基金账户：**指注册登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：**指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换和转托管等业务产生的基金份额变动及其结余情况的账户；
- 证券登记结算系统：**指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
- 注册登记系统：**指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统，又简称为 TA 系统；



- 转托管：**指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作；
- 系统内转托管：**投资者将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
- 跨系统转登记：**投资者将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为；
- 开放日：**指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T 日：**指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
- T + n 日：**指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)；
- 基金收益：**指基金投资所得股票红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间公允价值变动、银行存款利息以及其他合法收入；
- 基金资产总值：**指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
- 基金资产净值：**指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值：**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数所得的值；
- 基金财产估值：**指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
- 法律法规：**指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 不可抗力：**指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他

突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

## 第三节 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎投资管理 BE 控股公司（原名“富通基金管理公司”。与外方股东更名相关的变更程序目前正在办理之中）49%。

### （二）主要人员情况

**邵国有先生**，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

**吉宇光先生**，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997 年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

**艾德加（Stewart Edgar）先生**，董事，英国籍，学士。历任英国 Ivory & Sime 公共有限公司基金经理，美国 Fiduciary 国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国 HD 国际有限公司高级基金经理、董事，美国 F&C 管理公司高级基金经理、董事。1997 年至今任法国巴黎投资管理 BE 控股公司（原名“富通基金管理公司”）董事总经理。

**田仁灿先生**，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipment S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

**张文伟先生**，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

**董文标先生**，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长。现任中国民生银行董事长、党委书记。

**郑国汉先生**，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长。

**巴约特 (Marc Bayot) 先生**，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT 公司（布鲁塞尔）董事总经理、Pionner 投资公司（米兰，都柏林，卢森堡）和 Degroof 资产管理（布鲁塞尔）独立董事、基金联合公会（哥本哈根）独立董事。

**杨国平先生**，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任上海大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用（集团）股份有限公司董事长。

**李础前先生**，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

**余毓繁先生**，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行亚洲区行政总裁。

**奚万荣先生**，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003

年 4 月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

**章明女士**，督察长，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

**陈洪先生**，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金经理，2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金经理，2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长混合基金经理，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007 年 2 月至 2007 年 8 月任海富通风格优势股票基金经理，2007 年 4 月至 2007 年 8 月任海富通精选贰号混合基金经理，2008 年 6 月起任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

**阎小庆先生**，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表，海富通基金管理有限公司市场总监，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**牟永宁先生**，硕士，CFA。历任申银万国证券股份有限公司分析师，申万巴黎基金管理有限公司股票分析师。2004 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，任策略分析师、研究总监。2009 年 1 月起任海富通收益增长混合基金经理，2009 年 10 月起任海富通中证 100 指数（LOF）基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；蒋征，股票组合管理部总监；郭杰，股票组合管理部总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；戴德舜，研究总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （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. 办理基金备案手续；

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制中期和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）用基金资产承销证券；
- （6）用基金资产向他人贷款或提供担保；
- （7）用基金资产从事承担无限责任的投资；
- （8）用基金资产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- （9）以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （10）以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- (11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (12) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在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；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；
- (9) 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；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏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) 不得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

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(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，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性。

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

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

### 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制



度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开, 是公司各项基本管理制度的纲要和总揽, 内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上, 对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度, 并结合部门职责和业务运作的要求拟定, 其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合, 建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

### 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系, 董事会层面设立督察长, 管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部, 通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系, 对公司内部控制和 risk 管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈, 保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的风险委员会制定风险管理政策, 由管理层的风险管理委员会负责实施, 由风险管理部专职落实和监督, 公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施, 全面把握风险点, 将风险管理责任落实到人, 实现对风险的日常管理和过程中管理, 防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实, 通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查, 监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况, 识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险, 提出并完善公司各项合规性制度, 以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四节 基金托管人

### （一）基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、“中银理财”服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

多年来中国银行围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，中国银行脱颖而出，成为北京2008年奥运会唯一的银行合作伙伴；自1990年以来，中国银行一直荣登《财富》500强排行榜；2004至2008年，中国银行连续被《环球金融》杂志评为“中国最佳外汇银行”，并评为2008

年度中国最佳债券和现金管理银行；2008年，中国银行在《银行家》杂志“世界1000家大银行”中排名第10位；2008年中国银行被《财资》评为中国最佳贸易融资银行；2008年中国银行被《金融亚洲》评为最佳贸易融资银行、最佳外汇交易银行、最佳派息政策承诺奖、亚洲最佳公司（最佳股利政策）；2008年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为中国最佳外汇服务银行和中国本土最佳贸易服务银行；2008年中国银行被《欧洲货币》评为中国区最佳商业银行、中国区债务资本市场最佳投资银行、香港区最佳商业银行和中国区最佳外汇服务奖；2008年中国银行再次荣获“优信咨询（Universum）”评选的“最理想雇主奖”。

## （二）主要人员情况

肖钢先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自1996年10月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月，1981年毕业于湖南财经学院，1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自2004年8月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000年11月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于1980年11月至2000年11月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978年毕业于南京信息工程大学。2002年6月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生，自2007年11月27日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自2005年9月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，

1983年7月至2005年9月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于1962年11月，获得西南财经大学博士学位。

### （三）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念；根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析与监督、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收、行政管理等各层面的多个团队，现有员工110余人。另外，中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行设有托管业务团队。

### （四）证券投资基金托管情况

截止2009年12月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合（二期）、国泰金鹏蓝筹混合、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、金鹰成份优选股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、万家180指数、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、招商先锋混合、泰达荷银精选股票、泰达荷银集利债券、友邦华泰盛世中国股票、友邦华泰积极成长混合、友邦华泰价值增长股票、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、宝盈核心优势混合、国富成长动力股票、泰信蓝筹精选股票、友邦华

泰货币、国泰区位优势股票、招商行业领先股票、东方核心动力股票、金鹰行业优势股票、泰信债券增强收益、万家稳健增利债券、嘉实回报混合、海富通中证100指数（LOF）、易方达深证100ETF联接、摩根士丹利华鑫强收益债券型、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）等81只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型、创新型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### （五）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组，作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### （六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净

值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五节 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797

传真：021-33830160

#### 2、代销机构

##### (1) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### (2) 中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

客户服务中心电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

联系人：田耕

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

##### (3) 中国建设银行股份有限公司



地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

联系人：何奕

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

**(4) 中国农业银行股份有限公司**

地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

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

**(5) 交通银行股份有限公司**

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

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

**(6) 招商银行股份有限公司**

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

客户服务电话：95555

联系人：丰靖

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

**(7) 上海浦东发展银行股份有限公司**

地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务电话：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

**(8) 深圳发展银行股份有限公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼（Frank Neil Newman）

客户服务电话：95501

联系人：周勤

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

**（9）中信银行股份有限公司**

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

客服电话：95558

联系人：金蕾

电话：010-65557013

传真：010-65550827

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

**（10）中国民生银行股份有限公司**

地址：北京市东城区正义路4号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍、吴海鹏

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

**（11）广东发展银行股份有限公司**

地址：广州市农林下路83号

法定代表人：李若虹

客户服务电话：95508

联系人：詹全鑫 张大奕

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

**（12）浙商银行股份有限公司**

地址：中国杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

客户服务电话：995105665

联系人：吴军阳

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

**(13) 海通证券股份有限公司**

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

**(14) 中信证券股份有限公司**

地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010 - 84588266

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

**(15) 光大证券股份有限公司**

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：400-8888-788

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

**(16) 国泰君安证券股份有限公司**

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

客户服务电话：400-8888-666

联系人：韩星宇

网址：www.gtja.com

**(17) 中信建投证券有限责任公司**

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

**(18) 招商证券股份有限公司**

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：官少林

客户服务电话：400-8888-111 或 95565

联系人：林生迎

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

**(19) 兴业证券股份有限公司**

地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

客户服务电话：400-8888-123

联系人：谢高得

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

**(20) 华泰证券股份有限公司**

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：95597

联系人：万鸣

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

**(21) 华泰联合证券有限责任公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马昭明

客户服务电话：400-8888-555、95513

联系人：盛宗凌

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

**(22) 广发证券股份有限公司**

地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

联系人：黄岚

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

**(23) 长江证券股份有限公司**

地址：武汉市新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999 或 027-85808318

联系人：李良

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

**(24) 申银万国证券股份有限公司**

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客户服务电话：962505

联系人：邓寒冰

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

**(25) 东方证券股份有限公司**

地址：上海市浦东大道720号20楼

法定代表人：潘鑫军

客户服务电话：95503

联系人：吴宇

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

**(26) 国信证券股份有限公司**

地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

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

**(27) 中国银河证券股份有限公司**

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：顾伟国

客户服务电话：4008-888-888

联系人：田薇

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

**(28) 平安证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：95511

联系人：袁月

网址：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

**(29) 世纪证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

联系人：张婷

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

**(30) 中信金通证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

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

**(31) 中信万通证券有限责任公司**

地址：青岛市市南区东海路 28 号

法定代表人：史浩民

客户服务电话：电话：0532-96577

联系人：吴忠超

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

**(32) 东北证券股份有限公司**

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688

联系人：潘锴

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

**(33) 瑞银证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡

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

**(34) 国元证券股份有限公司**

地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

客户服务电话：0551-96888

联系人：陈琳琳

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

**(35) 德邦证券有限责任公司**

住所：上海市福山路500号城建大厦26层

法定代表人：方加春

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

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

**(36) 宏源证券股份有限公司**

公司注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源证券

法定代表人：汤世生

客户服务电话：010-62294600

联系人：李巍

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

**(37) 齐鲁证券有限公司**

地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

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

**(38) 第一创业证券有限责任公司**

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：0755-25832523

联系人：魏颖

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

**(39) 湘财证券有限责任公司**

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：陈学荣

客户服务电话：400-888-1551

联系人：鲁雁先

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

**(40) 安信证券股份有限公司**

地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

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

**(41) 中国建银投资证券有限责任公司**

地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层

法定代表人：杨小阳

客户服务电话：400-600-8008

联系人：刘权

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

**(42) 中国国际金融有限公司**

地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：易建军



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

(43) 中国民族证券有限责任公司

地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层

法定代表人: 赵大建

客户服务电话: 400-889-5618

联系人: 李薇

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

(44) 华宝证券有限责任公司

地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人: 陈林

客户服务电话: 4008209898

联系人: 刘闻川

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

(45) 信达证券股份有限公司

地址: 北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人: 张志刚

客户服务电话: 400-800-8899

联系人: 唐静

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

(46) 长城证券有限责任公司

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

客户服务电话: 400666888

联系人: 匡婷

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

(47) 方正证券有限责任公司

地址: 湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人: 张志刚

客户服务电话: 95571

联系人: 彭博

网址：www.foundersc.com

**(48) 广发华福证券有限责任公司**

地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：96326

联系人：张腾

网址：www.gfhfzq.com.cn

**(49) 渤海证券股份有限公司**

地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：张志军

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：www.ewww.com.cn

**(50) 东莞证券有限责任公司**

地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

客户服务电话：961130

联系人：梁建伟

网址：www.dgzq.com.cn

### 3、场内销售机构

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

#### （二） 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

**(三) 出具法律意见书的律师事务所**

通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号 时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-3135 8600

联系人：吕红

联系电话：021-31358666-8776

经办律师：秦悦民、王利民

**(四) 审计基金财产的会计师事务所**

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号 汇亚大厦 16 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号 普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、徐振晨

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：徐振晨

## 第六节 基金的募集

本基金经 2009 年 8 月 31 日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】第 879 号文核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从 2009 年 9 月 8 日起，至 2009 年 10 月 23 日止，共募集 2,087,148,875.30 份基金份额，有效认购户数为 21,475 户。

## 第七节 基金合同的生效

本基金的基金合同已于2009年10月30日正式生效。本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

## 第八节 基金份额的上市交易

本基金为上市契约型开放式基金，投资者可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式，实现基金份额的日常交易。

### 1、上市交易的地点

深圳证券交易所。

### 2、上市交易的时间

本基金已于2010年1月8日在深圳证券交易所上市交易。

### 3、上市交易的规则

- (1) 本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- (2) 本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- (3) 本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- (4) 本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- (5) 本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及其他有关规定。

### 4、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### 5、上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### 6、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

发生下列情形之一时，本基金应暂停上市：

- (1) 基金份额持有人数连续20个工作日低于1000人；
- (2) 基金总份额连续20个工作日低于2亿份；
- (3) 违反国家法律、行政法规，中国证监会决定暂停本基金上市；
- (4) 深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情形。

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请；经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市。

### 7、终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- （1）自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- （2）基金合同终止；
- （3）基金份额持有人大会决定终止上市；
- （4）深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

8、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 第九节 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

投资者可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回业务，场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者还可使用开放式基金账户，通过基金管理人、场外代销机构办理申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、发售公告或其他公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

### （二）申购与赎回办理的时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

基金合同生效后，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及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### 2. 申购与赎回的开始时间

本基金已于2010年1月8日起开始办理包括申购、赎回在内的日常交易业务。

3. 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换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。

### （三）申购与赎回的原则

1.“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基



金份额净值为基准进行计算；

2.“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3.投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按照新规定执行；

4.基金份额持有人赎回基金份额，注册登记系统遵循“先进先出”的原则，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的费率；

5.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，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

6.基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四） 申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请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须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回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，基金管理人或注册登记机构在T+1日内对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在T+2日起到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金销售机构受理申请并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购和赎回申请的确认以基金管理人或其委托的注册登记机构或的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构及相关基金销售机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自基金投资者提出的赎回申请被确认有效之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

## （五） 申购和赎回的数额和价格

### 1、 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1） 单笔申购的最低金额为 1000 元。

（2） 基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 1000 份基金份额，且通过场内单笔申请赎回的基金份额必须是整数份；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 1000 份的，需一并全部赎回。

（3） 本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 1000 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于 1000 份时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

2、 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

### 3、 申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。注册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，计算公式如下：

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

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

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

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资者；场外申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一，某投资者通过场外投资 5,000 元申购本基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,940.71 = 59.29 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,940.71 / 1.128 = 4,380.06 \text{ 份}$$

即：某投资者通过场外投资 5,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则可得到 4,380.06 份基金份额。

例二：某投资者通过场内投资 10,000 元申购本基金，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,881.42 / 1.025 = 9,640.41 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,640 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,640 \times 1.025 = 9,881.00 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,881.00 - 118.58 = 0.42 \text{ 元}$$

即：投资者投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,640 份，退款 0.42 元。

#### 4、赎回金额的计算

投资者在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费}$$

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例三：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

赎回费用=11,480×0.25%=28.70 元

净赎回金额=11,480-28.70=11,451.30 元

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金基金份额一年后(未满 2 年)赎回，假设赎回当日本基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

例四：某投资者从场内赎回本基金 10,000 份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即：投资者从深圳证券交易所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

#### 5、 基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。计算公式为：

$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金份额的余额数量}$

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

### (六) 申购与赎回的费用

1、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2、根据基金合同的规定，本基金申购费率不超过 5%，赎回费率不超过 5%。

3、申购费率按照申购金额逐级递减，注册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。实际执行的申购费率如下：

业务类型	金 额	费率
申购	申购金额 ≥ 500 万	按笔收取，1000 元/笔
	200 万元 ≤ 申购金额 < 500 万元	0.5 %
	100 万元 ≤ 申购金额 < 200 万元	0.8 %

	50 万元 ≤ 申购金额 < 100 万元	1.0%
	申购金额 < 50 万元	1.2%

4、场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

业务类型	持有期	费率
赎回	1 年以下	0.5%
	1 年（含）以上，2 年以下	0.25%
	2 年（含）以上	0%

场内赎回费率不区分基金份额的持有时间，而是为固定赎回费率 0.5%。

5、在遵守法律法规及基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对以特定交易方式（如网上交易等）进行基金交易的投资者等定期或不定期地开展。在基金促销活动期间，按照相关监管部门要求履行相关手续后，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、赎回费率。

6、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前 2 个工作日前在至少一种指定媒体公告。

### （七） 申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

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

3、投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施3个工作日前予以公告。

### （八） 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1.因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2.证券交易所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资

产净值。

3.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4.基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5.基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他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的情形。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。

2.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；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申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在中国证监会指定媒体上公告。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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### **（十）巨额赎回的情形及处理方式**

1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额

总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

## 2. 巨额赎回的处理方式

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

(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而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，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；当日未能赎回部分，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，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

## 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当立即向中国证监会备案，并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在 2 日内在指定媒体和公司网站上刊登公告。

连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒体和公司网站上进行公告。

### (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内至少一种指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净

值。

3.如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

4.如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。



## 第十节 基金的转换

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

## 第十一节 基金的非交易过户与转托管

### （一）非交易过户

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形;

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,直接向基金注册登记机构申请办理。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理; 申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

### （二）转托管

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下; 场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人深圳证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转登记。

#### 1、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构(网点)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

## 2、跨系统转登记

(1) 跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

(2) 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

具体办理方法参照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关规定以及基金代销机构的业务规则。

### (三) 冻结与解冻

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

### (四) 基金份额的质押

在相关法律法规有明确规定的条件下,基金注册登记机构可以办理基金份额的质押业务,并将制定和实施相应的业务规则。

## 第十二节 基金的投资

### （一）投资目标

本基金采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金管理人将力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。

### （二）投资方向和范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股、新股（首次公开发行股票或增发）、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如今后法律法规或监管机构允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资理念

本基金以跟踪中证 100 指数为原则，进行被动式指数化长期投资，使投资者充分分享中国经济增长和证券市场发展的成果。

### （四）投资策略

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

#### 1. 资产配置比例

本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，本基金将根据市场的实际情

况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。如果法律法规允许，本基金在履行适当程序后可以将股票投资比例提高到基金资产净值的100%，业绩比较基准同时相应变更，此事项无需召开基金份额持有人大会。

## 2. 股票投资组合构建

### (1) 股票组合构建原则及方法

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法进行投资。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。但在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- 1) 法律法规的限制；
- 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；
- 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- 5) 预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照同行业，相近市值，相关性高及 $\beta$ 值相近等原则来选择替代股票。

### (2) 股票组合调整

#### 1) 定期调整

本基金股票组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

#### 2) 不定期调整

##### a) 标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

##### b) 标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

c) 申购赎回调整

本基金将根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3) 跟踪偏离的监控与管理

本基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

3. 债券资产的配置策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。

## （五）投资决策

### 1、决策依据

- （1）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- （2）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- （3）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

（1）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

（2）投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

（3）分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

#### **(六) 业绩比较基准**

基金业绩比较基准 = 中证 100 指数×95% + 活期存款利率（税后）×5%

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。在指数样本股选取方面，中证 100 指数以沪深 300 指数样本股作为样本空间。根据总市值对样本空间内股票进行排名，挑选排名前 100 名的股票组成样本，但经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外。

如果中证 100 指数被停止编制及发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，在履行适当程序以后变更基金的投资目标、投资范围、标的指数和业绩比较基准。

#### **(七) 风险收益特征**

本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

#### **(八) 投资限制**

## 1、禁止用本基金财产从事以下行为

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

## 2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金持有的股票资产占基金资产比例为 90%-95%，持有的债券、现金等其它金融工具占基金资产的比例为 5%-10%;
- (2) 本基金投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的 80%;
- (3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限;
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限;
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (6) 本基金持有的同一权证不超过该权证的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;



(7)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

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

(9)基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%; 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(11)如果法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货及其它金融衍生工具时, 投资比例遵从法律法规和监管机构的规定;

(12)法律法规及中国证监会规定的其他限制。

本基金应在基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

### **(九) 基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则**

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

2.不谋求对上市公司的控股, 不参与所投资上市公司的经营管理;

3.有利于基金财产的安全与增值;

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

5.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利, 保护基金份

额持有人的利益。

### (十) 投资组合报告

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年5月27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至2010年3月31日（“报告期末”）。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	1,562,458,536.13	94.27
	其中：股票	1,562,458,536.13	94.27
2	固定收益类投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	92,664,639.36	5.59
	其他资产	2,263,043.92	0.14
	合计	1,657,386,219.41	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	192,300,957.08	11.68

C	制造业	314,603,632.06	19.10
C0	食品、饮料	60,454,018.17	3.67
C1	纺织、服装、皮毛	7,953,479.04	0.48
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	22,763,542.35	1.38
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	96,767,631.79	5.88
C7	机械、设备、仪表	122,055,704.03	7.41
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	4,609,256.68	0.28
D	电力、煤气及水的生产和供应业	60,484,887.62	3.67
E	建筑业	36,553,567.59	2.22
F	交通运输、仓储业	78,994,931.18	4.80
G	信息技术业	44,541,232.54	2.70
H	批发和零售贸易	22,546,233.74	1.37
I	金融、保险业	710,417,254.97	43.13
J	房地产业	81,508,508.71	4.95
K	社会服务业	10,476,413.64	0.64
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	10,030,917.00	0.61
	合计	1,562,458,536.13	94.86

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

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

#### 3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	代码	股票名称	数量	公允价值	占基金净资产比例(%)
----	----	------	----	------	-------------

1	600036	招商银行	5,993,156	97,568,579.68	5.92
2	600016	民生银行	8,966,365	68,951,346.85	4.19
3	601166	兴业银行	1,742,431	64,330,552.52	3.91
4	601318	中国平安	1,235,423	62,265,319.20	3.78
5	600030	中信证券	2,085,810	59,278,720.20	3.60
6	600000	浦发银行	2,293,642	52,249,164.76	3.17
7	601328	交通银行	5,370,442	44,467,259.76	2.70
8	601088	中国神华	1,411,376	40,788,766.40	2.48
9	000002	万科A	4,284,694	40,704,593.00	2.47
10	601601	中国太保	1,391,401	37,567,827.00	2.28

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、投资组合报告附注

(1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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

## (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	811,503.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,194.01
5	应收申购款	1,388,257.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	46,089.20
8	其他	-
9	合计	2,263,043.92

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## (5) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 第十三节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2010 年 3 月 31 日。

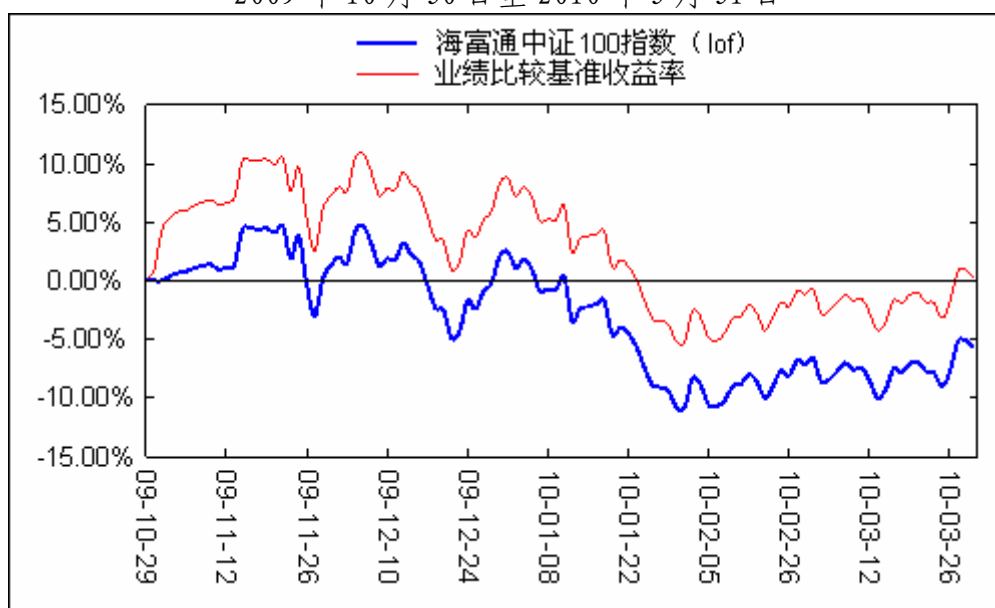
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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)	业绩比较基准标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2009 年 10 月 30 日 (基金合同生效日) - 2009 年 12 月 31 日	2.50%	1.53%	8.76%	1.61%	-6.26%	-0.08%
2009 年 10 月 30 日 (基金合同生效日) - 2010 年 3 月 31 日	-5.70%	1.39%	0.27%	1.43%	-5.97%	-0.04%

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:

2009 年 10 月 30 日至 2010 年 3 月 31 日



注：1、本基金合同于 2009 年 10 月 30 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。自2009年10月30日合同生效日起至2010年3月31日，本基金运作时间未满六个月，仍处于建仓期中。

## 第十四节 基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。

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

3. 基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

4. 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。

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



## 第十五节 基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金资产的价值。本基金份额的申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （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

基金所持有的资产和负债。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如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）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如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。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠

计量的情况下，按成本估值。

### (3) 有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

## 3、权证估值：

### (1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

### (2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的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，如果基金管理人认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

### （五）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，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金

财产价值时；

- 3、中国证监会认定的其他情形。

### **（七）基金份额净值的确认**

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

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

### **（八）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三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

- 2、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。当基金份额净值出现错误时，基金管理人和基金托管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；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

- 3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

### **（九）特殊情形的处理**

- 1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十六节 基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益，公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### （三）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金红利方式或红利再投资方式，登记在注册登记系统的基金份额，其持有人可自行选择收益分配方式，基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；投资者可在不同销售机构对本基金选择相同的分红方式，也可选择不同的分红方式，即在各销售机构选择的分红方式相互独立、互不影响。

登记在证券登记结算系统中的基金份额只支持现金红利方式，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

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

5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不超过 15 个工作日；

7、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；

8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日、基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

#### （五）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

#### （六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构可自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日除权后的基金份额净值转为基金份额。

## 第十七节 基金的费用和税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、基金的指数使用费；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的 0.7% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：



$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.12% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的 0.12% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

## 3. 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，且收取下限为每季度（包括基金成立当季）人民币 5 万元。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季一个月內从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4、本条第（一）款第 3 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### （五）与基金销售有关的费用

### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十八节 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告，并报中国证监会备案；
- 3、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同意。

## 第十九节 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### (一)招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站

上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## (二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## (三)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## (四)基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## (五)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2.基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## (六)基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

## (七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1.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。基金年度报告中的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2.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。

4. 基金合同生效不足 2 个月的,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告;

#### (八)临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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件时,有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案:

- 1.基金份额持有人大会的召开;
- 2.终止基金合同;
- 3.转换基金运作方式;
- 4.更换基金管理人、基金托管人;
- 5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6.基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7.基金募集期延长;
- 8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9.基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
- 10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
- 11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14.重大关联交易事项;
- 15.基金收益分配事项;
- 16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

- 17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
- 18.基金改聘会计师事务所;
- 19.变更基金份额发售机构;
- 20.基金更换注册登记机构;
- 21.本基金开始办理申购、赎回;
- 22.本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- 23.本基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24.本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25.本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- 26.中国证监会规定的其他事项。

#### (九)澄清公告

在基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十)基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内,由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

#### (十一)中国证监会规定的其他信息

#### (十二)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点,供公众查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第二十章 风险揭示

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着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，基金投资的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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有



效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

#### （四）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

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

#### （五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### （六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### （七）模型风险

指在估计资产价值、市场分析和风险估计中采用了错误的估计方法或选择了不恰当的模型而导致投资结果不确定风险。

#### （八）其他风险

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

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

## 第二十一节 基金的终止和清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1)基金份额持有人大会决定终止的；
- (2)基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3)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在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4)基金合并、撤销；
- (5)中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金的清算

#### 1.基金财产清算小组

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

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

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

#### 2.基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

- (1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)将基金清算结果报告中国证监会；
- (7)参加与基金财产有关的民事诉讼；

- (8)公布基金财产清算结果;
- (9)对基金剩余财产进行分配。

### 3.清算费用

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

### 4.基金财产按下列顺序清偿:

- (1)支付清算费用;
- (2)交纳所欠税款;
- (3)清偿基金债务;
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

### 6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十二节 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利与义务

#### （一）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，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的权利与义务。

#### （二）基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取或委托收取投资者认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

（5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

（6）在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择和更换基金代销机构，并有权依照代销协议

和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券，并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 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；

(15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### (三)基金管理人员的义务

(1) 依法申请并募集基金，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) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

(6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 接受基金托管人依据法律法规、本基金合同和托管协议进行的监督；

(10) 采取适当合理的措施使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；

(11) 计算并公告基金资产净值及基金份额净值；

(12) 按照法律法规和本基金合同的规定，编制并公告基金季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告，履行信息披露及报告义务；

(13) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(14) 按法律法规和基金合同的规定办理基金份额的认购、申购、赎回等业务和/或委托其他机构代理有关业务，及时、足额支付赎回款项；

(15) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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

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

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(21) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

#### (四)基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 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；

(6) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### (五)基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合

格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

(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) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 保守基金商业秘密。除法律法规、基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；



(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

(17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作;

(18) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;

(19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

(20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

#### (六) 基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益;

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产;

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7) 监督基金管理人的投资运作;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### (七) 基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人；
- 5、更换基金托管人；

- 6、变更基金类别；
- 7、变更基金投资目标、范围或策略；
- 8、变更基金份额持有人大会程序；
- 9、本基金与其他基金合并；
- 10、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、降低本基金的赎回费率或变更本基金的收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动、监管部门要求而应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四) 召集方式：

- 1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
- 2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人

提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，该比例以提出提议之时提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）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的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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

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

#### （五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持

有人大会通知将至少载明以下内容:

- 1、会议召开的时间、地点、方式;
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式(如采用通讯表决方式,还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。);
- 3、代理投票授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- 4、会务常设联系人姓名、电话;
- 5、有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- 6、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 7、召集人需要通知的其他事项。

#### (六) 开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会;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。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、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

- 1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证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、本基金合同和会议通知的规定;
- 2、经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全

部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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；

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权益登记日基金总份额的 50% 以上；

4、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5、会议通知公布前已根据监管部门的要求备案。

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

#### (七) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容限为本条前述第(二)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

b、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做出决定。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做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

### (八) 表决

- 1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。
- 2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

## (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上通过。除上述(1)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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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。

## (九) 计票

### 1、现场开会

(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表,如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人,则监督员由基金托管人担任;如基金托管人为召集人,则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)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中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。



(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，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，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。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## (十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4. 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十一)法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### (一) 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形,或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人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

有下列情形之一的,基金经中国证监会批准后将终止:

1、基金份额持有人大会决定终止;

2、基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;

3、法律法规或中国证监会允许的其他情形。

基金合同终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定,行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

#### 四、争议解决方式

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。

## 第二十三节 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1.1 基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48 号

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

#### 1.2 基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收

付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 2.1 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（A）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督，基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督；

3、对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，

并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

(1) 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

(2) 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

(3) 如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的投资总监批准。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

(B) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(C) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(D) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》

及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(E) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

## 2.2 基金管理人 对基金托管人的业务核查

A. 在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

B. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应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，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

C. 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### (三) 基金财产的保管

### 3.1 基金资产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### 3.2 基金募集期满时募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### 3.3 基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。



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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

### **3.4 基金进行定期存款投资的账户开设和管理**

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

### **3.5 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理**

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本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/深圳分公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分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。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

### **3.6 债券托管专户的开设和管理**

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

### 3.7 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

### 3.8 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## （四）基金资产净值计算和会计核算

### 4.1 基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。基金管理人和基金托管人也可以以其他双方确认的方式确认基金份额净

值。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。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，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；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除本合同另有规定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 4.2 基金会计核算

### 1、基金账册的建立

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、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由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 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 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或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告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保管**

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

#### **（六）争议解决方式**

（1）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（2）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（3）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### **（七）托管协议的修改与终止**

### （1）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

### （2）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十四节 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送服务

#### 1. 投资者对账单

基金投资者对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单由注册登记人在每年度结束后 15 个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

#### 2. 其他相关的信息资料

介绍国内外金融市场动态、投资机会和投资产品等。

### （二）红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，注册登记人将基金份额持有人所获现金红利按权益登记日经除息后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）基金间转换服务

投资者可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额。

### （四）定期投资计划

基金管理人利用直销网点或代销网点为投资者提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期投资计划的有关规则详见基金管理人公告。

### （五）在线服务

基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理（或投资顾问）的定期在线交流服务；基金管理人还提供网上交易服务，具体操作详见网上交易业务规则。

### （六）咨讯服务

投资者如果了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询、查询。

**1. 客户服务电话**

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

**2. 互联网站**

公司网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

**（七） 投诉受理**

投资者可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或致函，投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

**（八） 网上开户与交易服务**

基金管理人已开通网上交易平台，投资者可登陆海富通基金网站（[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)）实现网上开户和交易（包括认购、申购、定期定额申购、转换、赎回等），并获得申购费率和部分转换费率优惠。海富通网上交易支持工商银行、农业银行、建设银行、兴业银行、浦发银行、中信银行等银行的借记卡，具体的费率优惠标准请参见相关公告。基金管理人将依据业务发展状况，逐步增加网上交易支持的银行卡种，并以公告形式告知投资者。



## 第二十五章 其他披露事项

### （一）基金注册登记机构

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的注册登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资者基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、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。

注册登记机构的更换程序：

（1）提名：由基金管理人提名。

（2）核准：新任注册登记机构报中国证监会审查资格并核准后，原任注册登记机构方可退任；

（3）公告：基金注册登记机构更换，由基金管理人在更换前 30 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。

（4）交接：原基金注册登记机构应做出处理基金注册登记事务的报告，并与新任基金注册登记机构完成业务移交手续，向新任基金注册登记机构提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记机构与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金注册登记机构仍有义务保留本基金正式移交日之前的注册登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金注册登记机构处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记机构业务移交产生的问题，原基金注册登记机构仍有协助解决之义务。

**2.基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记业务。**

#### 3.基金注册登记机构概况

基金注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：金颖

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## 第二十六节 基金管理人和基金托管人的更换

### (一)基金管理人的更换

#### 1.基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

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

#### 2.基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1)提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3)核准：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准，更换基金管理人的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行；新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

(4)交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；

(5)审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

(6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后 2 日内公告；

(7)基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，

应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

## (二)基金托管人的更换

### 1.基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

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

### 2.基金托管人的更换程序

(1)提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3)核准：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行；新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

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

(5)审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(6)公告：基金托管人更换后，由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后 2 日内公告。

## (三)基金管理人与基金托管人同时更换

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

2.基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3.公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

(四)新任基金管理人接收基金管理业务或新任基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

## 第二十七节 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资者也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。上述备查的文件其内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十八节 备查文件

本招募说明书的备查文件包括：

- （一）中国证监会批准海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）设立的文件
- （二）《海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- （三）《海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- （四）注册登记协议
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）海富通基金管理有限公司募集设立海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的法律意见书
- （八）《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。