

中欧鼎利分级债券型证券投资基金  
更新招募说明书  
（2013年第1号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

二〇一三年一月

## 重要提示

本基金经 2011 年 4 月 13 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧鼎利分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]550 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2011 年 6 月 16 日正式生效。

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财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书所载内容截止日 2012 年 12 月 15 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

|                                   |    |
|-----------------------------------|----|
| 一、绪言                              | 5  |
| 二、释义                              | 5  |
| 三、基金管理人                           | 11 |
| 四、基金托管人                           | 20 |
| 五、相关服务机构                          | 24 |
| 六、基金份额的分级                         | 39 |
| 七、基金的募集                           | 43 |
| 八、基金合同的生效                         | 43 |
| 九、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的上市交易            | 44 |
| 十、中欧鼎利份额的场外申购、转换与赎回               | 45 |
| 十一、中欧鼎利份额的场内申购与赎回                 | 53 |
| 十二、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记 | 58 |
| 十三、基金的投资                          | 59 |
| 十四、基金的业绩                          | 71 |
| 十五、基金的财产                          | 72 |
| 十六、基金资产的估值                        | 73 |
| 十七、基金的收益分配                        | 78 |
| 十八、基金的费用与税收                       | 79 |
| 十九、基金份额折算                         | 80 |
| 二十、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的终止运作           | 83 |
| 二十一、基金的会计与审计                      | 84 |
| 二十二、基金的信息披露                       | 85 |
| 二十三、风险揭示                          | 89 |
| 二十四、基金合同的终止与基金财产的清算               | 94 |
| 二十五、基金合同的内容摘要                     | 96 |
| 二十六、基金托管协议的内容摘要                   | 96 |
| 二十七、对基金份额持有人的服务                   | 96 |
| 二十八、其他应披露事项                       | 97 |

|                        |     |
|------------------------|-----|
| 二十九、招募说明书的存放及查阅方式----- | 99  |
| 三十、备查文件-----           | 99  |
| 附件一：基金合同摘要-----        | 100 |
| 附件二：托管协议摘要-----        | 117 |

## 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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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》”）等有关法律法规及《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中欧鼎利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

## 二、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：

1. 基金或本基金：指中欧鼎利分级债券型证券投资基金
2. 基金管理人：指中欧基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中信银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中欧鼎利分级债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6. 招募说明书：指《中欧鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7. 基金份额发售公告：指《中欧鼎利分级债券型证券投资基金份额发售公告》

8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、地方性法规、地方政府规章以及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及其不时修订

9. 《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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》及颁布机关对其不时做出的修订

10. 《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11. 《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12. 《运作办法》：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》及颁布机关对其不时做出的修订

13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15. 基金份额分级：指本基金的基金份额包括中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额、中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额与中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额。其中，中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额与中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额的基金份额数配比始终保持7:3的比率不变

16. 中欧鼎利份额：指中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额

17. 鼎利A份额：指获取稳健收益的基金份额，即中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额

18. 鼎利B份额：指获取进取收益的基金份额，即中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额

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

20. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

21. 机构投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国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

22. 合格境外机构投资者：指符合现行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

23. 投资人：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人的合称

24. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

25. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

26. 场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理中欧鼎利份额认购、申购和赎回等业务的基金销售机构及其场所

27. 场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理中欧鼎利份额认购、申购、赎回以及鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易等业务的场所

28. 直销机构：指中欧基金管理有限公司

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

30. 场内代销机构：代为办理场内基金销售业务，具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位

31. 代销机构：除特别说明外，指场外代销机构和场内代销机构的合称

32. 销售机构：指直销机构和代销机构

33. 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  
包括投资人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

34. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

35. 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登记结算系统

36. 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

37. 基金账户：指基金投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录投资人持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。基金投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

38. 深圳证券账户：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。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

39. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

40. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

41. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

42. 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

43. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

44. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

45. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日



46. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
47. 开放日：指为投资人办理中欧鼎利份额申购、赎回或其他业务的工作日
48. 封闭期：指根据本基金合同中关于基金运作方式的约定，对中欧鼎利份额采取封闭式运作的期间，在该期间内基金份额持有人不得申请申购、赎回中欧鼎利份额
49. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
50. 《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《上市开放式基金业务指引》、《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》等相关业务规则及其不时修订，是规范基金管理人管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
51. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
52. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买中欧鼎利份额的行为
53. 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将中欧鼎利份额兑换为现金的行为
54. 份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的中欧鼎利份额的场内份额与鼎利A份额、鼎利B份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面
55. 分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每10份中欧鼎利份额的场内份额申请转换成7份鼎利A份额与3份鼎利B份额的行为
56. 合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每7份鼎利A份额与3份鼎利B份额进行配对申请转换成10份中欧鼎利份额的场内份额的行为
57. 基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的约定，对本基金所有份额进行折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为1.000元的行为
58. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行

为。基金份额持有人持有的登记在证券登记结算系统的场内基金份额需经跨系统转托管至注册登记系统后方可申请办理基金转换业务

59. 转托管：指基金份额持有人将其所持有的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为，包括系统内转托管和跨系统转登记

60. 系统内转托管：指基金份额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

61. 跨系统转登记：指基金份额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

62. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

63. 巨额赎回：指本基金单个开放日，中欧鼎利份额净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额（包括中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额）的 10%

64. 元：指人民币元

65. 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

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

67. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

68. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

69. 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

70. 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

71. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法避免、无法克服且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无

法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
3. 办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
4. 法定代表人：唐步
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2006年7月19日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：吉亦超
13. 客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.2亿元人民币
15. 股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资5,880万元人民币，占公司注册资本的49%；

国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的47%；

万盛基业投资有限责任公司出资480万元人民币，占公司注册资本的4%；

上述三个股东共出资12,000万元人民币。

#### （二）主要人员情况

##### 1. 基金管理人董事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。21年以上证券从业经

验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

Marco D' Este 先生，中欧基金管理有限公司副董事长。意联银行(UBI Banca)机构银行业务部总监，曾任布雷西亚农业信贷银行（简称“CAB”）国际部总监，联合信贷银行(Unicredit) 米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，联合信贷银行东京分行资金部经理，并曾在Credito Italiano(意大利信贷银行) 圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

Guido Masella 先生，中欧基金管理有限公司董事，意大利籍。曾任意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

陈金占先生，中欧基金管理有限公司董事，中国籍。历任国都证券有限责任公司副总经理、中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

Barry Livett 先生，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司（International Securities Consultancy Ltd.）咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

刘桓先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

肖微先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

## 2. 基金管理人监事会成员

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事

务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

刘中先生，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

刘玫女士，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商投资促进中心项目经理、加拿大 DESROSIERS—LOMBARDI—DOLBEC 注册会计师事务所审计师、美国 GENERAL EASTERN TRADING 公司财务经理。

### 3. 公司高级管理人员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，16 年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

黄桦先生，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，22 年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

周蔚文先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2011 年 5 月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2011 年 8 月起至今），中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自 2012 年 3 月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，13 年以上证券及基金从业经验。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自 2006 年 11 月起至 2011 年 1 月），中欧基金管理有限公司研究部总监。

朱彦先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大

学经济学学士，23 年以上信托、证券及基金从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工，海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管，海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理，北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理，国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理、上海长阳路证券营业部总经理，中欧基金管理有限公司督察长。

#### 4. 本基金基金经理

聂曙光先生，中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理，中国籍。复旦大学企业管理专业硕士，8 年以上证券从业经验。历任南京银行债券分析师，兴业银行上海分行债券投资经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理兼研究员（主要负责宏观、债券研究），中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（2010 年 5 月 10 日起至 2011 年 7 月 28 日）。现任中欧基金管理有限公司固定收益部总监、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理（2010 年 12 月 2 日起至今）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理（2011 年 6 月 16 日起至今）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理（2012 年 4 月 16 日起至今）。

#### 5. 公司投资决策委员会成员

公司投资决策委员会的成员为：公司副总经理兼投资总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、总经理助理兼权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、研究部副总监杨坤女士、专户理财部副总监沈洋先生、基金经理王海先生。其中副总经理兼投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

#### 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. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

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

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理中欧鼎利份额申购和赎回申请；
- (8) 依据本基金合同的约定，转换本基金运作方式；
- (9) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (10) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (12) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (13) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (14) 依法召集基金份额持有人大会；
- (15) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）计算并公告基金资产净值、中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后的份额转换比例；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；

（10）按规定受理中欧鼎利份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

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

（17）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；

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

（19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、



变现和分配；

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

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

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （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）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

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及行业规范，诚实信用、勤勉尽责。

5. 基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

### （五）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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
3. 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### （六）基金管理人的内部控制制度

#### 1. 内部控制的原则

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

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

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

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

#### 2. 内部控制的体系结构

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，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：

（1）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。

（2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

（3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行

定期、不定期报告。

（4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

（5）风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

（6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

（7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

### 3. 内部控制的措施

（1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的

应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）建立完善的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4. 基金管理人关于内部合规控制声明书

基金管理人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基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人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。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人的情况

#### 1. 基金托管人情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：方韡

联系电话：010-65556812

传真：010-65550832

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。经过二十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

中信银行拥有一支业绩卓越、经验丰富的管理团队，他们在金融领域平均拥有超过二十年的从业及管理经验，均为业内知名专家，具有创新的管理理念及全面的操作经验。近年来，在这支优秀管理团队的带领下，中信银行秉承“坚持效益、质量、规模协调发展”、“追求滤掉风险的利润”、“追求稳定增长的市值”和“努力走在中外银行竞争前列”经营管理理念，积极发展公司银行业务、零售银行业务、国际业务、资金资本市场业务、投资银行业务、汽车金融业务、托管业务、信用卡业务和私人银行业务等，并拥有一流的对公客户服务能力，领先同业的国际贸易结算业务、物流融资业务和资金资本市场业务，极具创新能力的投资银行业务以及特色鲜明的零售银行发展战略享誉业界。

中信银行的业务辐射全球70多个国家和地区，全国近600家分支机构战略性地分布在经济发展迅速的中国东部、沿海地区以及内陆的经济中心城市。16000多名员工为客户提供最佳、高效、综合的金融解决方案，以及优质、便捷的网上银行、电话银行以及信用卡客户服务中心等电子银行服务。享誉海内外的中信品

牌及独具优势的综合金融服务平台推动着中信银行的发展。与欧洲领先的西班牙对外银行的战略合作将使中信银行在零售银行、风险管理等多个领域如虎添翼。中信银行已经建立了独立、全面、垂直、专业的风险管理体系，追求滤掉风险的效益，不断提升量化风险的技术能力，以全面实施《巴塞尔协议 II》风险管理要求为目标，不断提升资产管理水平。近几年来，中信银行信贷资产不良率大大低于上市银行的平均水平，资产质量显著提高。凭借业务的快速发展，优秀的管理能力、出色的财务表现和审慎的风险控制，中信银行近年来的成就广获业界认同，并深受国内外权威机构的肯定。在英国《金融时报》公布的“2008 年全球市值 500 强企业排行榜中，中信银行首次入榜即排名第 260 位。在英国《银行家》杂志公布的 2008 年度“世界 1000 家银行”排行榜中，中信银行一级资本排名位居第 77 位。在英国《银行家》杂志评出“全球 2008 年金融品牌价值 500 强”排行中，中信银行的品牌价值排在第 99 位，傲然迈入百强行列。在中国《银行家》杂志推出的《2007 中国商业银行竞争力评价报告》中显示，中信银行在 2007 年全国性商业银行核心竞争力排名和 2007 年全国性商业银行财务评价排名中均获得第五名。同时，中信银行整体品牌形象获得“年度最佳股份制银行”、“年度最受尊敬银行”、“中国金融营销奖”之“最佳企业社会责任奖”和“北京奥运会、残奥会运行保障突出贡献单位”等荣誉称号。不仅如此，中信银行在专业领域还获有“亚洲十佳商业银行最佳公司业务奖”、“2007 年度中国最佳现金管理银行”、“2008 年度中国 CFO 最信赖银行大奖”、“最佳财富管理奖”、“最佳理财品牌塑造奖”、“年度最佳人民币理财银行”、“2008 读者最关注的零售银行”、“交易量最大做市商”、“做市交易量最大做市商”、“年度最佳风险控制银行”、“中国股票组合管理最佳私人银行奖”、“2008 年度最具投资能力私人银行”、“最佳发卡银行奖”、“中国最佳呼叫中心”、“金融行业十大最佳雇主”等奖项和称号。2009 年，中信银行通过了美国 SAS70 内部控制审订并获得无保留意见的 SAS70 审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

## 2. 主要人员情况

朱小黄先生，中信银行行长，高级经济师，并获中国政府特殊津贴。1982 年湖北财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业，1985 年北京大学经济法专

业专科毕业，2006年中山大学世界经济专业博士毕业。曾任中国建设银行股份有限公司副行长兼首席风险官。现任中国中信集团有限公司党委委员、中国中信股份有限公司副总经理、中信银行党委书记及行长。

苏国新先生，中信银行副行长，分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任、同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997年6月开始担任中信集团董事长秘书。1991年8月至1993年10月，在中国外交部工作。1993年10月至1997年5月在中信集团负责外事工作。1996年1月至1997年1月，在瑞士银行SBC和瑞士联合银行UBS等金融机构工作。

刘勇先生，中信银行托管中心总经理。男，1965年出生，中共党员，硕士研究生。曾任中信银行贸易结算部副总经理，中信银行总行营业部国际业务部总经理，中信银行国际业务管理部总经理，中信银行上海分行行长助理兼风险主管，中信银行国际业务部副总经理。2007年6月至今，任中信银行托管中心总经理，负责全行托管业务。

### 3. 基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2012年12月31日，中信银行已托管20只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，总托管规模逾7200亿元。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标。强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

2. 内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3. 内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4. 内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、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的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。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。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

### （二）场外发售机构

#### 1. 直销机构：



(1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人：吉亦超

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：www.lcfunds.com

(2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址：www.lcfunds.com

2. 代销机构（排名不分先后）

(1) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：王斌

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

(2) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

电话：95533

传真：010-66275654

客服热线：95533

联系人：张静

网址：www.ccb.com

(3) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

法定代表人：李国华

传真：010-68858117

联系人：陈春林

客服热线：95580

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

（4）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

电话：021-52629999

联系人：刘玲

客服热线：95561

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

（5）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户热线：95568

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

（6）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755—83195109

联系人：邓炯鹏

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

（7）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：陈铭铭

客户热线：95559

网址：www.bankcomm.com

（8）广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38322256

传真：020-87310955

客服热线：400-830-8003

网址：www.cgbchina.com.cn

（9）深圳发展银行股份有限公司

注所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行 27F

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：0755—82088888

传真：0755-25841098

客服热线：95501

网址：www.sdb.com.cn

（10）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

电话：010-85238422

传真：010-85238419

联系人：李远征

客服热线：95577

网址：www.hxb.com.cn

（11）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（12）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼

法人代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

（13）广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：林治海

电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

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

（14）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服热线：4008888108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（15）国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

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

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客服热线：400-818-8118

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

（16）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄正大五道口广场 1 号楼 22 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565783

联系人：谢高得

客服热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（17）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

传真：010-66045527

客服热线：010-66045678

网址：www.txsec.com、jijin.txsec.com

（18）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服热线：4008888788，10108998

网址：www.ebscn.com

（19）华福证券有限责任公司

住所：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 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

传真：0591-87383610

联系人：张腾

联系热线：0591-87383623

网址：www.hfzq.com.cn

（20）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

电话：010-62267799-6416

传真：010-62294601

联系人：张智红

客服热线：4008-000-562、010-62294600

网址：www.hysec.com

（21）中国银河证券股份有限公司

住所：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：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568990

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（22）齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531—68889752

客服热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（23）申银万国证券股份有限公司

住所：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

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：李清怡

客服热线：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

（24）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服热线：95553

网址：www.htsec.com

（25）国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法人代表：凤良志

联系人：李飞

电话：0551-2246298

传真：0551-2272100

客服热线：95578，4008888777



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

（26）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

开放式基金业务传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

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

（27）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路618号

办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服热线：4008888666

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

（28）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02

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

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服热线：4008-001-001

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

（29）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（30）华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路90号

办公地址：南京市中山东路90号

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

电话：025-83290979

传真：025-51863323

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

（31）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767880

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

（32）英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦西区 11 楼 1105B

法定代表人：赵文安

联系人：吴尔晖

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

客服热线：4008-698-698

网址：www.ydsc.com.cn

（33）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客服热线：95558

网址：www.citics.com

（34）爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888-25113

传真：021-68728703

客服热线：021-63340678

网址：www.ajzq.com

（35）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

客服热线：4008-888-228

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

（36）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服热线：0532-96577

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

（37）中信证券（浙江）有限责任公司

住所：中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼

办公地址：中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼

法定代表人：沈强

联系人：周研

电话：0571-86078823

客服热线：0571-96598

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

（38）联讯证券有限责任公司

住所：广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼

办公地址：广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼

法定代表人：徐刚

联系人：张悦

电话：0752-2119391

客服热线：400-8888-929

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

（39）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-4890619

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

（40）深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系电话：0755-33227953

众禄基金销售网：www.zlfund.cn

基金买卖网：www.jjmmw.com

（41）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000-766-123

传真：0571-26698533

联系电话：0571-28829790

网址：www.fund123.cn

（42）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服热线：400-089-1289

传真：021-58788678-8815

联系电话：021-58788678

网址：www.erichfund.com

（43）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

客服热线：400-1818-188

传真：021-64385308

联系电话：021-54509998-7019

网址：www.1234567.com.cn

（44）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

传真：021-68596916

联系电话：021-58870011

网址：www.ehowbuy.com

（45）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：汪静波

客服热线：400-821-5399

传真：021-38509777

联系电话：021-38602377

网址：www.noah-fund.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

### （三）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京市西城区太平桥大街17号  
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号  
法人代表：金颖  
联系人：朱立元  
电话：010-59378839  
传真：010-59378907

### （四）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：韩炯  
经办律师：吕红、黎明  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：吕红

### （五）会计师事务所和经办注册会计师

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1318号星展银行大厦6楼  
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  
电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：刘颖  
经办会计师：单峰、刘颖

## 六、基金份额的分级

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括“中欧鼎利份额”、“鼎利A份额”与“鼎利B份

额”。其中，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额配比始终保持 7:3 的比率不变。

## （二）基金的基本运作概要

1. 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金合同生效时，场外认购的全部份额将确认为中欧鼎利份额；场内认购的全部份额将按 7:3 的比率确认为鼎利 A 份额与鼎利 B 份额。

2. 本基金合同生效后一年内，中欧鼎利份额封闭式运作，不接受场外与场内申购和赎回；本基金合同生效满一年后，中欧鼎利份额接受场外与场内申购和赎回。

3. 本基金合同生效后，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额只上市交易，不接受申购和赎回。

4. 本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理中欧鼎利份额与鼎利 A 份额、鼎利 B 份额之间的份额配对转换业务。

5. 本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算并对折算后的中欧鼎利份额的场内份额按照 7:3 的比例拆分为鼎利 A 份额与鼎利 B 份额。

### （1）中欧鼎利份额的份额折算

基金份额折算日折算后，中欧鼎利份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元，中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额的份额数按照中欧鼎利份额折算比例相应增加、缩减或不变。若折算前，中欧鼎利份额净值大于 1.000 元，则折算后中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额增加；若折算前，中欧鼎利份额净值小于或等于 1.000 元，则折算后中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额缩减或不变。

### （2）鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的份额折算

基金份额折算日折算后，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额按照折算前各自的基金份额净值折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额，具体折算公式如下：

鼎利 A (B) 份额的折算比例 = 折算日折算前鼎利 A (B) 份额的基金份额净值 / 1

鼎利 A (B) 份额折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额数量 = 折算前鼎利 A (B) 份额数量 × 鼎利 A (B) 份额的折算比例



鼎利 A 份额、鼎利 B 份额折算成的中欧鼎利份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### （3）折算后中欧鼎利份额场内份额的分拆

在基金份额折算后，中欧鼎利份额的场内份额按照 7:3 的比例分拆成鼎利 A 份额与鼎利 B 份额。届时，分拆后的鼎利 A 份额、鼎利 B 份额与中欧鼎利份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。

### （三）鼎利 A 份额与鼎利 B 份额概要

#### 1. 存续期限

自基金合同生效之日起存续

#### 2. 基金份额配比

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额数配比始终保持 7:3 的比率不变。

#### 3. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额可终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

### （四）基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值。

#### 1. 中欧鼎利份额的基金份额净值计算

中欧鼎利份额的基金份额净值计算公式为：

$T$  日中欧鼎利份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金的基金份额（包括中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额）余额总数

例：假设  $T$  日闭市后，本基金的基金资产净值为 55 亿元，中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额余额分别为 12 亿份、28 亿份与 12 亿份，则中欧鼎利份额的基金份额净值计算如下：

$T$  日中欧鼎利份额的基金份额净值 =  $55 / (12 + 28 + 12) = 1.058$  元

#### 2. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值计算

(1) 本基金 7 份鼎利 A 份额与 3 份鼎利 B 份额构成一对份额组合，一对鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的份额组合的净值之和将等于 10 份中欧鼎利份额的净值。

(2) 鼎利 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款利率加上 1%。其中“一年期银行定期存款利率”指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率。

鼎利 A 份额的约定收益率除以 365 为鼎利 A 份额的约定日简单收益率。鼎利 A 份额的份额净值以基金合同生效日或折算日 1 元净值为基准采用鼎利 A 份额的约定日简单收益率单利进行计算。

(3) 鼎利 B 份额的份额净值根据中欧鼎利份额的份额净值、鼎利 A 份额的份额净值以及中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的份额净值关系计算。

(4) 如果根据上述计算规则计算出来的鼎利 B 份额的份额净值小于或等于 0.300 元，或者自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满三年且期间每个工作日鼎利 B 份额的份额净值都大于 0.300 元的，则基金管理人将根据基金合同约定，对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到 1.000 元。

(5) 鼎利 A 份额、鼎利 B 份额折算日折算后份额净值都调整为 1.000 元，折算后鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的份额净值计算方法保持不变。

(6) 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值计算公式

假设上一折算日后第  $t$  个自然日，中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值分别为  $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ ，上一折算日次日的一年期银行定存利率为  $R$ 。则第  $t$  个自然日，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值计算如下：

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 1\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.7 \times NAV(A)_t) / 0.3$$

例：假设上一折算日后第 100 个自然日，中欧鼎利份额净值分别为 1.100、1.008、0.797 时，上一折算日次日的一年期银行定存利率为 3.0%。

(1) 当  $NAV_t = 1.100$  时

根据基金份额净值计算规则，鼎利 A 份额和鼎利 B 份额的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (3.0\% + 1.0\%) \times 100 / 365 = 1.011$$

$$NAV(B)_t = (1.100 - 0.7 \times 1.011) / 0.3 = 1.307$$

(2) 当  $NAV_t = 1.008$  时

根据基金份额净值计算规则，鼎利 A 份额和鼎利 B 份额的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (3.0\% + 1.0\%) \times 100 / 365 = 1.011$$

$$NAV(B)_t = (1.008 - 0.7 \times 1.011) / 0.3 = 1.000$$

(3) 当  $NAV_t = 0.797$  时

根据基金份额净值计算规则，鼎利 A 份额和鼎利 B 份额的份额净值为：

$$NAV(A)_t = 1 + (3.0\% + 1.0\%) \times 100 / 365 = 1.011$$

$$NAV(B)_t = (0.797 - 0.7 \times 1.011) / 0.3 = 0.298$$

由于鼎利 B 份额净值小于 0.300 元，则基金管理人将根据基金合同约定，自该日起三个工作日内对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到 1.000 元。

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2011 年 4 月 13 日证监许可[2011]550 号文核准募集发售。募集期为 2011 年 5 月 9 日至 2011 年 6 月 10 日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 875,257,397.74 份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为 6,984 户。

## 八、基金合同的生效

(一) 基金合同生效

本基金基金合同于 2011 年 6 月 16 日正式生效。

(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 九、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的上市交易

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易。基金份额上市后，投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖鼎利 A 份额和鼎利 B 份额。

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （二）上市交易的时间

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额已于 2011 年 9 月 15 日开始在深圳证券交易所上市交易。

### （三）上市交易的规则

1. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；
2. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一工作日的基金份额净值；
3. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

### （四）上市交易的费用

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

### （五）上市交易的行情揭示

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额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。

### （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

（七）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，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十、中欧鼎利份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于中欧鼎利份额的场外申购和赎回业务。

### （一）场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务：

1. 本基金管理人的直销机构。
2. 不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售机构由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或代销机构另行公告。

### （二）场外申购与赎回的开放日及办理时间

1. 本基金合同生效后一年内，中欧鼎利份额封闭式运作，不接受场外与场内申购和赎回；本基金合同生效满一年后，中欧鼎利份额接受场外与场内申购和赎回。本基金不接受鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的申购或赎回申请。投资人可在申购中欧鼎利份额后按基金合同约定申请分拆为鼎利 A 份额与鼎利 B 份额，或可在申请将其持有的鼎利 A 份额与鼎利 B 份额合并为中欧鼎利份额后申请赎回。

基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的 3 个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

（注：中欧鼎利份额已经从 2012 年 6 月 18 日起开始办理场外与场内申购和赎回业务。）

2. 场外申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场或证券交易所交易时间更改或实

际情况需要，基金管理人可对申购、赎回或转换时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （三）场外申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中欧鼎利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. 场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有的中欧鼎利份额在注册登记系统确认的先后次序进行顺序赎回；

4. “全额缴款”原则，投资人申购中欧鼎利份额时，必须全额缴付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

5. 当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销，在基金管理人规定的时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （四）场外申购与赎回的程序

#### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人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，投资人在提交赎回申请时须持有足够的中欧鼎利份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到销售机构或以销售机构规定的其他方式及时查询申购与赎回申请的确认情况，否则如因申请未得到注册登记机构的确认而产生的后果，由投资人自行承担。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表

销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人，该退回款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金管理人在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

#### （五）场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T+2 日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### （六）场外申购与赎回的限制

##### 1. 申购金额的限制

场外申购时，代销网点每个账户单笔申购的最低金额为 1,000 元人民币。

直销机构每个账户首次申购的最低金额为 10,000 元人民币，追加申购单笔最低金额为 10,000 元人民币；已在直销机构有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。（通过本公司网上交易系统申购本基金暂不受此限制，具体规定请至本公司网站查询。）

##### 2. 赎回份额的限制

场外赎回时，赎回的最低份额为 5 份基金份额；基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 5 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

（七）场外申购费用和赎回费用

1. 申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金场外申购费率如下表：

| 单笔金额 (M)            | 收费标准      |
|---------------------|-----------|
| M < 50 万元           | 0.8%      |
| 50 万元 ≤ M < 100 万元  | 0.5%      |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.3%      |
| M ≥ 500 万元          | 每笔 1000 元 |

2. 赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，不低于赎回费总额的25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金场外赎回费率如下表：

| 持有基金份额期限 (N)  | 收费标准  |
|---------------|-------|
| N < 1 年       | 0.1%  |
| 1 年 ≤ N < 2 年 | 0.05% |
| N ≥ 2 年       | 0     |

在场外认购、场外申购的投资人其份额持有年限以份额实际持有年限为准；在场内认购、场内申购以及场内买入，并转托管至场外赎回的投资人其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算。

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（八）场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算



1. 申购份额与赎回金额的处理方式：

（1）申购份额、余额的处理方式：场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以有效申请当日中欧鼎利份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日中欧鼎利份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2. 申购份额的计算：

中欧鼎利份额以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。中欧鼎利份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

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

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

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

例：某投资人投资 40,000 元申购中欧鼎利份额，申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购金额} = 40,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 40,000 / (1 + 0.8\%) = 39,682.54 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 40,000 - 39,682.54 = 317.46 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (40,000 - 317.46) / 1.040 = 38,156.29 \text{ 份}$$

即：某投资人投资 40,000 元申购中欧鼎利份额，假设申购当日中欧鼎利份额净值为 1.040 元，则可得到 38,156.29 份中欧鼎利份额。

3. 场外赎回支付金额的计算：

中欧鼎利份额以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。中欧鼎利份额的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = T \text{ 日申请份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

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

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

例：某投资人赎回 10,000 份中欧鼎利份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日中欧鼎利份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 = 10,000 × 1.016 = 10,160 元

赎回费用 = 10,160 × 0.10% = 10.16 元

赎回金额 = 10,160 - 10.16 = 10,149.84 元

即：投资人赎回 10,000 份中欧鼎利份额，假设赎回当日中欧鼎利份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,149.84 元。

#### （九）拒绝或暂停场外申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的中欧鼎利份额场外申购申请。此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

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. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 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。
6. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或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利益的情形。
7. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、6、7 项暂停场外申购情形时，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。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停场外申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停场外赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人中欧鼎利份额的场外赎回申请或延缓支付赎回款项。此时，本基金的转出申请将按同样方式处理：

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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
6. 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，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将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，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付，但最长不超过 20 个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资人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。

#### （十一）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中欧鼎利份额净赎回申请（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）超过前一开放日的基金总份额（包括中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额）的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的场外处理方式

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场外赎回申请全额赎回或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人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，可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；对于未能赎回部分，投资人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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：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 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、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，同时在指定媒体上刊登公告。

#### （十二）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，在指定媒体上刊登中欧鼎利份额重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的中欧鼎利份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，中欧鼎利份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登中欧鼎利份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的中欧鼎利份额净值。

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，中欧鼎利份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登中欧鼎利份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的中欧鼎利份额净值。

#### （十三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办中欧鼎利份额与基金管理人管理、且由同一注册登记机构办理注册登记的的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根

据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （十四）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理中欧鼎利份额定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十五）基金的冻结和解冻

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、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十一、中欧鼎利份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于中欧鼎利份额通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

#### （一）投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者，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。

#### （二）使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回中欧鼎利份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

#### （三）场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单（有可能进行调整或变更）可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

#### （四）申购与赎回的办理时间

1. 本基金合同生效后一年内，中欧鼎利份额封闭式运作，不接受场外与场

内申购和赎回；本基金合同生效满一年后，中欧鼎利份额接受场外与场内申购和赎回。本基金不接受鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的申购或赎回申请。投资人可在申购中欧鼎利份额后按基金合同约定申请分拆为鼎利 A 份额与鼎利 B 份额，或可在申请将其持有的鼎利 A 份额与鼎利 B 份额申请合并为中欧鼎利份额后申请赎回。

基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的 3 个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

（注：中欧鼎利份额已经从 2012 年 6 月 18 日起开始办理场外与场内申购和赎回业务。）

2. 场内申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。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。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回、转换申请的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下次办理基金份额申购、赎回、转换时间所在开放日的价格。

3. 基金合同生效后，若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### （五）场内申购和赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中欧鼎利份额净值为准进行计算；

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. “全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

4. 当日的中欧鼎利份额申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### （六）场内申购和赎回的程序

1. 申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购中欧鼎利份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够中欧鼎利份额余额，否则赎回申请无效。

## 2. 申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况，否则如因申请未得到注册登记机构的确认而产生的后果，由投资人自行承担。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资人账户，由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。

关于“巨额赎回的认定”和“巨额赎回的公告”参照第十章相关内容规定。

### （七）场内申购和赎回的数额限制

1. 单笔场内申购的最低金额为1,000元，同时申购金额必须是整数金额。

2. 基金管理人可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。如调整上述限制的，基金管理人必须在调整3个工作日前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

3. 申购份额、余额的处理方式：中欧鼎利份额的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整

数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。

4. 赎回金额的处理方式：中欧鼎利份额的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。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，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（八）申购费用和赎回费用

1. 本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金场内申购费率如下表：

| 单笔金额 (M)            | 收费标准      |
|---------------------|-----------|
| M < 50 万元           | 0.8%      |
| 50 万元 ≤ M < 100 万元  | 0.5%      |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.3%      |
| M ≥ 500 万元          | 每笔 1000 元 |

2. 投资人可将其持有的全部或部分中欧鼎利份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内赎回费率为固定值 0.1%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

3. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（九）中欧鼎利份额场内申购份额和赎回金额的计算方式

1. 中欧鼎利份额申购份额的计算

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

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

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

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资 10,000 元申购中欧鼎利份额，对应的申购费率



为 0.8%，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：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 0.8\%) = 9,920.63 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 10,000 - 9,920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,920.63 / 1.025 = 9,678.66 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得中欧鼎利份额为 9,678 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,678 \times 1.025 = 9,919.95 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,919.95 - 79.37 = 0.68 \text{ 元}$$

即：投资人投资 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 9,678 份，退款 0.68 元。

## 2. 中欧鼎利份额基金赎回金额的计算

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

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

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

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则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：某投资人从深交所场内赎回中欧鼎利份额 10,000 份，赎回费率为 0.1%，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：

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

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.1\% = 11.48 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 11.48 = 11,468.52 \text{ 元}$$

即：投资人从深交所场内赎回本基金 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 11,468.52 元。

3. T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在次日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

### （十）场内申购与赎回的登记结算

中欧鼎利份额场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所

及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（十一）办理中欧鼎利份额场内申购、赎回业务应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有关业务规则。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，将按新规定执行。

（十二）有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第十章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

## 十二、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### （一）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；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、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （二）基金份额的登记

1. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的中欧鼎利份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；鼎利 A 份额、鼎利 B 份额、以及场内认购、申购的中欧鼎利份额登记在证券登记结算系统持有人深圳证券账户下。

2. 登记在证券登记结算系统中的中欧鼎利份额可直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的中欧鼎利份额如需办理场外赎回，应当办理跨系统转登记后方可实施。

3. 登记在注册登记系统中的中欧鼎利份额可直接申请场外赎回。登记在注

册登记系统中的中欧鼎利份额如需办理场内赎回或分拆成鼎利 A 份额、鼎利 B 份额进行上市交易，应当办理跨系统转登记后方可实施。

### （三）系统内转托管

1. 系统内转托管是指基金份额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中欧鼎利份额场外赎回业务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理中欧鼎利份额系统内转托管。

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鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易或中欧鼎利份额场内赎回的会员单位（席位）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

### （四）跨系统转登记

1. 跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的中欧鼎利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公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。

本基金可以从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的 3%。

中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

#### 1. 资产配置策略

本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、证券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。

本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整大类资产的配置比例。

#### 2. 固定收益类资产投资策略

##### （1）久期配置策略

久期反映了利率变化对债券价格的敏感程度，本基金将通过对宏观经济趋势和利率走势的预判确定组合整体久期，有效的控制组合的利率风险。预期利率上升时，本基金降低组合久期；预期利率下行时，拉长组合久期。

##### （2）利率期限结构配置策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化。一般情况下，在债券收益率曲线变陡时，采取子弹型策略组合；在债券收益率曲线变平时，采取哑铃型策略组合；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采取梯形策略。

##### （3）骑乘策略

在预期未来收益率曲线变动较为平稳时，通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

#### （4）息差策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金可先投入初始资金买入国债，并用所持有的国债进行回购，回购后的资金再买入收益率高于回购利率的其他国债或金融债、企业债，并在回购期末，出售全部现券，并偿还回购融入资金。

#### （5）信用策略

本基金通过对行业及个券信用评级等方法有效的控制投资的信用风险，在承担适度信用风险的基础上，挖掘收益能有效覆盖风险的投资品种来获取较高的收益，力争做到投资组合安全与收益相结合。

#### （6）可转债投资策略

本基金在充分研究的基础上，选择条款有利、行业前景看好、公司基本面良好的可转债进行一级市场申购，并根据二级市场转债价格的估值水平、股性特征和债性特征评估等进行二级市场投资。

#### （7）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指将缺乏流动性但可预测未来现金流的资产组成资产池并以其所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金充分分析基础资产质量及未来现金流，严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资。

#### （8）流动性策略

本基金还将根据个券发行总量、流通量、上市时间、交易量等流动性指标，决定该个券投资总量的上限。

### 3. 非固定收益类资产投资策略

#### （1）二级市场股票投资策略

本基金的股票类资产投资作为整体投资组合管理的辅助工具，为投资人提供适度参与股票市场的机会。

本基金的备选股票库由公司投研团队负责建立和维护。投研团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等，预测上市公司未来盈利前景，并据此申请将股票纳入备选股票库。

在备选股票库的基础上，本基金量化考察上市公司净资产收益率等财务指标和市净率、市盈率等估值指标以及市盈增长比率等指标，以兼顾和平衡公司增长能力和股票估值水平。同时，本基金根据公司投研团队的研究成果，对个股基本

面进行定性分析，选择具有增长潜力且估值水平合理的个股进行投资。

## （2）新股申购策略

本基金将综合考虑近期市场估值水平、上市首日涨幅、新股中签率和申购机会成本、锁定期限内股价表现和市场资金供求关系等因素，结合公司基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、公司基本面良好、定价偏低的个股进行申购，规避质量较差的公司。

## （3）权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

## （四）投资决策

### 1. 投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

### 2. 投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

### 3. 投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，主要负责评价并批准基金的资产配置提案；协同风险控制委员会，审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险，并在必要时做出修改。

投资总监全面负责公司基金投资管理业务，协调所有基金的投资活动，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理负责通过与研究部的通力合作，拟定资产配置提案提交投资决策委员会；并负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

### 4. 投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

#### 5. 风险分析与绩效评估

数量分析师负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

#### 6. 组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

#### （五）业绩比较基准

业绩比较基准： $\text{中国债券总指数} \times 90\% + \text{沪深 300 指数} \times 10\%$ 。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制并于2001年12月31日推出的中国全市场债券指数，该指数同时覆盖了交易所和银行间两个债券市场的主要固定收益证券并以债券托管量市值为样本券权重，该指数能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一

致，并在更新的招募说明书中列示，报中国证监会备案。

#### （六）风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。其中，鼎利 A 份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。鼎利 B 份额表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额，类似于具有收益杠杆性的债券型基金份额。

#### （七）投资限制

##### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）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%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金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%；
- （4）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%；
- （5）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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （6）本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%；
- （7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （9）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%；
- （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）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；

（12）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；

（13）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%；

（14）中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（15）法律法规或中国证监会规定的其他限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，或中国证监会规定禁止的其他活动；

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，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。

(九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十) 基金投资组合报告

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

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金 2012 年第 3 季度报告，所载数据截至 2012 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 3,323,350.00   | 1.10         |
|    | 其中：股票  | 3,323,350.00   | 1.10         |
| 2  | 固定收益投资 | 210,215,625.20 | 69.39        |
|    | 其中：债券  | 210,215,625.20 | 69.39        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 3 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 4 | 买入返售金融资产          | 62,000,168.20  | 20.46  |
|   | 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      | 22,226,535.46  | 7.34   |
| 6 | 其他各项资产            | 5,195,991.27   | 1.72   |
| 7 | 合计                | 302,961,670.13 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别        | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业    | -          | -            |
| B  | 采掘业         | -          | -            |
| C  | 制造业         | 720,150.00 | 0.25         |
| 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 | 19,830.00  | 0.01         |
| C5 | 电子          | 420,450.00 | 0.15         |
| C6 | 金属、非金属      | 127,000.00 | 0.04         |
| C7 | 机械、设备、仪表    | 21,770.00  | 0.01         |
| C8 | 医药、生物制品     | 131,100.00 | 0.05         |

|     |                |              |      |
|-----|----------------|--------------|------|
| C99 | 其他制造业          | -            | -    |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 2,400,000.00 | 0.83 |
| E   | 建筑业            | -            | -    |
| F   | 交通运输、仓储业       | -            | -    |
| G   | 信息技术业          | -            | -    |
| H   | 批发和零售贸易        | -            | -    |
| I   | 金融、保险业         | 203,200.00   | 0.07 |
| 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             | 3,323,350.00 | 1.15 |

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 600795 | 国电电力 | 1,000,000 | 2,400,000.00 | 0.83         |
| 2  | 002415 | 海康威视 | 10,000    | 277,200.00   | 0.10         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 20,000    | 203,200.00   | 0.07         |
| 4  | 300115 | 长盈精密 | 5,000     | 143,250.00   | 0.05         |
| 5  | 300016 | 北陆药业 | 10,000    | 131,100.00   | 0.05         |
| 6  | 002318 | 久立特材 | 10,000    | 127,000.00   | 0.04         |
| 7  | 600066 | 宇通客车 | 1,000     | 21,770.00    | 0.01         |
| 8  | 600141 | 兴发集团 | 1,000     | 19,830.00    | 0.01         |

|    |   |   |   |   |   |
|----|---|---|---|---|---|
| 9  | - | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - | - |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | 19,342,000.00  | 6.70         |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 28,118,071.05  | 9.75         |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,928,000.00  | 6.91         |
| 6  | 中期票据      | 71,847,000.00  | 24.90        |
| 7  | 可转债       | 70,980,554.15  | 24.60        |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 210,215,625.20 | 72.86        |

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

| 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  | 1282048   | 12魏桥MTN1  | 400,000 | 40,932,000.00 | 14.19        |
| 2  | 1182226   | 11首钢MTN1  | 300,000 | 30,915,000.00 | 10.71        |
| 3  | 041253037 | 12联通CP001 | 200,000 | 19,928,000.00 | 6.91         |
| 4  | 1101096   | 11央行票据96  | 200,000 | 19,342,000.00 | 6.70         |
| 5  | 110018    | 国电转债      | 118,830 | 12,458,137.20 | 4.32         |

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

(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库之外的股票。

(3) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 500,000.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,874,101.20 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,815,530.90 |
| 5  | 应收申购款   | 6,359.17     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,195,991.27 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|---------|--------------|
|----|------|------|---------|--------------|

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 1  | 110018 | 国电转债 | 12,458,137.20 | 4.32 |
| 2  | 110016 | 川投转债 | 10,921,530.00 | 3.79 |
| 3  | 110013 | 国投转债 | 7,267,400.00  | 2.52 |
| 4  | 113002 | 工行转债 | 7,070,000.00  | 2.45 |
| 5  | 110003 | 新钢转债 | 6,151,800.00  | 2.13 |
| 6  | 110012 | 海运转债 | 5,917,200.00  | 2.05 |
| 7  | 110011 | 歌华转债 | 5,104,550.00  | 1.77 |
| 8  | 110017 | 中海转债 | 4,551,500.00  | 1.58 |
| 9  | 125887 | 中鼎转债 | 2,935,031.95  | 1.02 |
| 10 | 125089 | 深机转债 | 2,793,840.00  | 0.97 |
| 11 | 110007 | 博汇转债 | 1,010,800.00  | 0.35 |
| 12 | 110015 | 石化转债 | 973,000.00    | 0.34 |
| 13 | 125731 | 美丰转债 | 547,345.00    | 0.19 |
| 14 | 113001 | 中行转债 | 192,320.00    | 0.07 |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十四、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

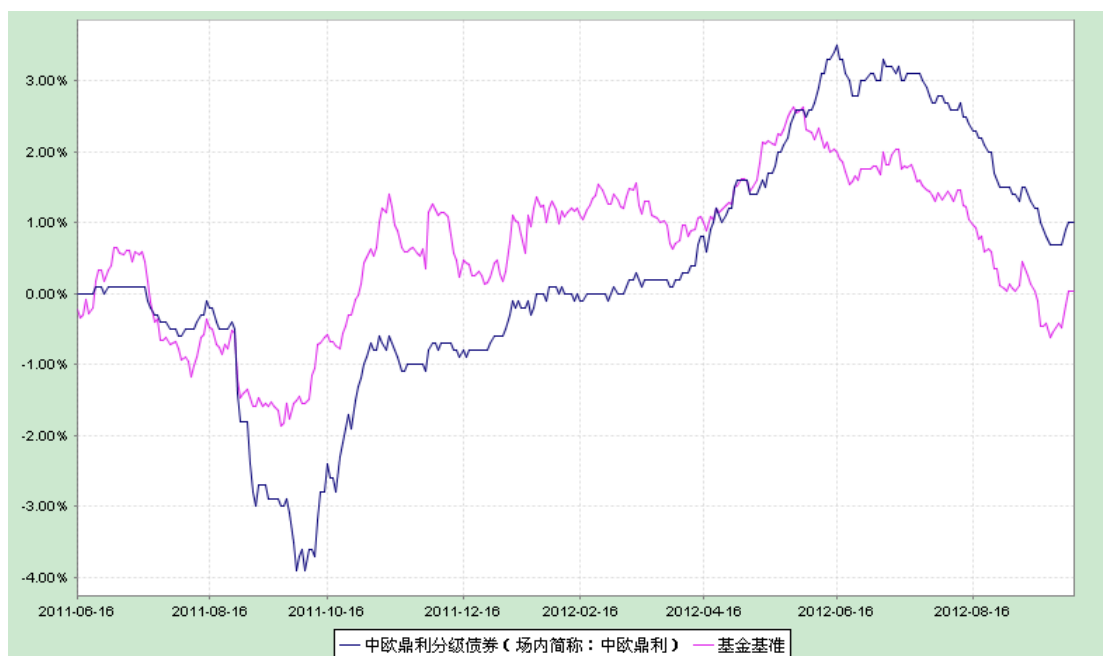
本基金合同生效日2011年6月16日，基金业绩截止日2012年9月30日。

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                   | ①净值增长率 | ②净值增长率标准差 | ③业绩比较基准收益率 | ④业绩比较基准收益率标准差 | ①-③    | ②-④    |
|----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2011.6.16—2011.12.31 | -0.60% | 0.18%     | 0.47%      | 0.18%         | -1.07% | 0.00%  |
| 2012.1.4—2012.9.30   | 1.61%  | 0.11%     | -0.43%     | 0.14%         | 2.04%  | -0.03% |
| 2011.6.16—2012.9.30  | 1.00%  | 0.14%     | 0.03%      | 0.15%         | 0.97%  | -0.01% |

数据来源：中欧基金 Wind

## 2. 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



数据来源：中欧基金 Wind

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户



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

#### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。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互抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。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。

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。

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

## 十六、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4. 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。

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

6. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

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

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### （四）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应当每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错

的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

## 2. 差错处理原则

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

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人

和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告。

（3）因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应当按照法律法规的规定向基金或基金份额持有人进行赔偿。

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### （六）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 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. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

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

#### （八）特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人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。

## 十七、基金的收益分配

#### （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

基金的收益分配比例以期末（收益分配基准日）可供分配利润为基准计算。基金期末可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### （三）收益分配原则

本基金（包括中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十八、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

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

### （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

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

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费、托管费外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### （五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十九、基金份额折算

### （一）基金份额折算日

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日鼎利 B 份额的份额净值都大于 0.300 元，则最后工作日为基金份额折算日；如果期间某个工作日鼎利 B 份额的份额净值小于或等于 0.300 元，则该日后的三个工作日内某个工作日为基金份额折算日，具体的基金份额折算日见基金管理人届时发布的公告。

### （二）基金份额折算类别

根据基金份额折算日的触发条件不同，基金份额折算日分为基金份额到期折算日和基金份额到点折算日，基金份额折算也相应地分为基金份额到期折算和基



金份额到点折算。

#### 1. 基金份额到期折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日鼎利 B 份额的份额净值都大于 0.300 元，则最后工作日为到期折算日。在到期折算日实施的基金份额折算为基金份额到期折算。

#### 2. 基金份额到点折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满三年的最后工作日止，如果期间某个工作日鼎利 B 份额的份额净值小于或等于 0.300 元，则该日后的三个工作日内某工作日为到点折算日，具体的基金份额到点折算日见基金管理人届时发布的公告。在到点折算日实施的基金份额折算为基金份额到点折算。

#### （三）基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的本基金所有份额。

#### （四）基金份额折算方法

基金份额到期折算和基金份额到点折算的折算方法一致，均按以下方法在基金份额折算日对所有基金份额进行折算：

#### 1. 中欧鼎利份额的份额折算

基金份额折算日折算后，中欧鼎利份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。折算后，中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额的份额数按照中欧鼎利份额折算比例相应增加、缩减或不变。若折算前，中欧鼎利份额净值大于 1.000 元，则折算后中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额增加；若折算前，中欧鼎利份额净值小于或等于 1.000 元，则折算后中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额缩减或不变。

中欧鼎利份额的折算比例 = 折算日折算前中欧鼎利份额的基金份额净值 / 1

中欧鼎利份额经折算后的份额数 = 折算日折算前中欧鼎利份额的份额数 × 中欧鼎利份额的折算比例

中欧鼎利份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；中欧鼎利份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### 2. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的份额折算

基金份额折算日折算后，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额按照折算前各自的基金份额净值折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额的场内份额，具体折算公式如下：

鼎利 A（B）份额的折算比例 = 折算日折算前鼎利 A（B）份额的基金份额净值 / 1

鼎利 A（B）份额折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额数量 = 折算前鼎利 A（B）份额数量 × 鼎利 A（B）份额的折算比例

鼎利 A 份额、鼎利 B 份额折算成的中欧鼎利份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### 3. 折算后中欧鼎利份额场内份额的分拆

在基金份额折算后，将中欧鼎利份额的场内份额按照 7:3 的比例分拆成鼎利 A 份额与鼎利 B 份额。届时，分拆后的鼎利 A 份额、鼎利 B 份额与中欧鼎利份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。

例：假设基金份额折算日折算前中欧鼎利份额的基金份额净值为 1.250 元，鼎利 A 份额的基金份额净值为 1.135 元，鼎利 B 份额的基金份额净值为 1.518 元，投资人甲持有中欧鼎利份额的场外份额 10000 份，投资人乙持有中欧鼎利份额的场内份额 30000 份，投资人丙持有鼎利 A 份额 50000 份，投资人丁持有鼎利 B 份额 80000 份，则：

份额折算后中欧鼎利份额的基金份额净值为 1.000 元

中欧鼎利份额的折算比例 =  $1.250 / 1 = 1.250$

投资人甲持有的中欧鼎利份额的场外份额经折算后的份额数 =  $10000 \times 1.250 = 12500$  份

投资人乙持有的中欧鼎利份额的场内份额经折算后的份额数 =  $30000 \times 1.250 = 37500$  份。根据折算后的分拆规则，每 10 份中欧鼎利份额的场内份额将拆分成净值为 1.000 元的 7 份鼎利 A 份额与 3 份鼎利 B 份额。37500 份中欧鼎利份额的场内份额将分拆为 26250 份鼎利 A 份额和 11250 份鼎利 B 份额。

鼎利 A 份额的折算比例 =  $1.135 / 1 = 1.135$

鼎利 B 份额的折算比例 =  $1.518 / 1 = 1.518$

投资人丙持有的鼎利 A 份额折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额的场内份额数量 =  $50000 \times 1.135 = 56750$  份。根据折算后的分拆规则，56750 份中欧鼎利

份额的场内份额将分拆为 39725 份鼎利 A 份额和 17025 份鼎利 B 份额。

投资人丁持有的鼎利 B 份额折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额的场内份额数量 =  $80000 \times 1.518 = 121440$  份。根据折算后的分拆规则，12144 份中欧鼎利份额的场内份额将分拆为 85008 份鼎利 A 份额和 36432 份鼎利 B 份额。

#### （五）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的上市交易和中欧鼎利份额的申购或赎回等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （六）基金份额折算的公告

1. 在基金份额实施到期折算前，基金管理人将在至少一家指定媒体和基金管理人网站，就实施到期折算的有关事项进行提示性公告。

2. 本基金运作期间，如鼎利 B 份额净值在某一开放日高于 0.450 元，但在下一开放日不高于 0.450 元的，基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3. 本基金运作期间，如鼎利 B 份额净值在某一开放日小于或等于 0.300 元，则该日后的两个工作日内，基金管理人将就基金份额实施到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4. 基金份额到期或到点折算结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果的具体内容。

## 二十、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的终止运作

（一）经基金份额持有人大会决议通过，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

#### （二）鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后的份额转换

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规

定的，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额将全部转换成中欧鼎利份额的场内份额。

#### 1. 份额转换基准日

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

#### 2. 份额转换方式

在转换基准日日终，以中欧鼎利份额的基金份额净值为基准，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额按照各自的基金份额净值转换成中欧鼎利份额的场内份额。鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）基金份额持有人持有的转换后中欧鼎利份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的转换比率 = 份额转换基准日鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的基金份额净值 / 份额转换基准日中欧鼎利份额的基金份额净值

鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）基金份额持有人持有的转换后中欧鼎利份额的场内份额数 = 基金份额持有人持有的转换前鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的份额数 × 鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的转换比率

#### 3. 份额转换后的基金运作

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额全部转换为中欧鼎利份额的场内份额后，本基金接受场外与场内的申购和赎回。

#### 4. 份额转换的公告

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额进行份额转换结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 二十一、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；

6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## （二）基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，经书面通知基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 二十二、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》、基金合同编制基金招募说明书，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）基金份额上市交易公告书

鼎利A份额和鼎利B份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在鼎利A份额和鼎利B份额上市交易的3个工作日前，将相关基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### （六）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，基金上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值和基金资产净值；

2. 在鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 在开始办理中欧鼎利份额申购或者赎回后，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，披露开放日的中欧鼎利份额基金份额净值和基金份额累计净值；

4. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的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，将中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金资产净值、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。

#### （七）中欧鼎利份额的申购、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中欧鼎利份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （八）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。

5. 基金定期报告应当按有关规定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。

#### （九）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及决议；
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0.50%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 基金变更、增加或减少代销机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 中欧鼎利份额开始办理申购、赎回；
22. 中欧鼎利份额申购、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. 本基金暂停接受中欧鼎利份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 本基金鼎利 A 份额与鼎利 B 份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
27. 本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；
28. 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
29. 本基金实施基金份额折算；
30. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作；
31. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的份额转换；
32. 中国证监会、深圳证券交易所或本基金合同规定的其他事项。

#### （十）澄清公告

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

#### （十一）基金份额持有人大会决议

#### （十二）中国证监会规定的其他信息

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，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人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。

## 二十三、风险揭示

### （一）市场风险与对策

由于经济和政治环境、产业和行业状况、上市公司基本面等方面的变化，可

能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动，进而影响基金份额净值。市场风险主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、公司经营风险、通货膨胀风险和财务风险等。其中，政策风险是指有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的法规、举措出台，引起证券市场的波动，从而给投资人带来风险；经济周期风险是指证券市场行情周期性变动而引起的风险，这种行情变动不是指证券价格的日常波动和中级波动，而是指证券行情长期趋势的改变；利率风险是指市场利率变动引起证券投资收益变动的可能性，市场利率的变化会引起证券价格变动，并进一步影响证券收益的确定性；公司经营风险是指公司的决策人员与管理人员在经营管理过程中出现失误而导致公司盈利水平变化，从而使投资人预期收益下降的可能；通货膨胀风险是指由于通货膨胀、货币贬值给投资人带来实际收益水平下降的风险；财务风险是指公司财务结构不合理、融资不当而导致投资人预期收益下降的风险。

为控制此类风险，本基金管理人将努力加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率走势和行业发展趋势，以此作为资产配置和证券选择的依据；本基金管理人的风险控制系统实施对从个股/个券到全部组合等风险源的全面风险管理，从而得以实时监控组合风险敞口，及时识别风险源并调整投资组合；本基金将通过构建多样化组合并限制单只证券过高持仓以避免个股/个券过度风险；岗位风险管理职能方面：本基金管理人的业绩和风险评价小组自行开发风险管理系统并将定期出具业绩和风险评价报告，重点股票的波动性、贝塔系数、风险值和债券的剩余期限、久期、凸性等指标；基金经理和投资总监将负责时时监控组合风险头寸并决定是否调整投资组合；风险控制委员会负责每月审阅业绩和风险评价报告。

## （二）流动性风险与对策

在基金转为上开放式基金后的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，进而影响基金份额净值。

为控制此类风险，本基金管理人的投资组合管理和交易系统设置了预警和自

动控制功能，以便对基金交易中可能存在的流动性风险发出警报；基金运营部将与代销机构、托管行保持高效沟通以及时预测资金流动；基金经理将每日依据基金运营部提供的信息监控基金的净现金头寸和资金流入/流出情况；业绩和风险评价小组定期计算流动性及可能存在的风险，并出具报告提交基金经理、投资总监和风险控制委员会。

另外，投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面重大变化而导致流动性降低，基金管理人难以在合理的时间内以公允价格将其变现而引起资产的损失或交易成本的不确定性，从而产生流动性风险。本基金将根据个别债券发行总量、流通量、上市时间等流动性指标，决定投资总量。

### （三）管理风险与对策

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

为控制此类风险，本基金管理人将充分发挥中外合资基金管理公司在国际化和本土化方面的双重优势，吸取国内外同行业在投资管理方面的经验教训，引进外资股东的先进管理经验和管理技术，建立优秀的管理团队和专业团队；同时，本基金管理人实施积极的人才战略，通过外部引进、内部培训、科学考核、有效激励等多种方式不断提高团队的经营管理水平和投资研究能力，并根据实际情况引进新的管理技术和方法，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报；投资总监、投资决策委员会对基金经理助理、基金经理和投资总监等各级岗位的基金投资分别实施不同的投资交易限制以及重要交易的逐级授权制度，从而确保实现对于管理风险的有效监督和管理。

### （四）信用风险与对策

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

为控制此类风险，本基金管理人将选择资信状况良好的机构作为本基金交易对手，投资于具备较高信用评级的债券并尽可能通过多样化持债回避信用风险。

### （五）其它风险

## 1. 操作风险与对策

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

为控制此类风险，本基金管理人将在充分考虑内外部环境的基础上，建立科学、严密、高效的内部控制体系；投资组合管理和交易系统中设置了交易前的自动限制和控制功能，以防止主观和客观的错误交易和违规交易。中央交易室每日提交交易报告以便投资总监和风险控制委员会及时发现操作中存在的问题并予以修正。同时，本基金管理人注重提高员工专业水平，并加强员工职业道德教育，以促进合规文化的形成。

## 2. 技术风险与对策

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

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

## 3. 其它风险与对策

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争及代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

为控制这类风险，本基金管理人建立了突发紧急事件处理制度以及完备的灾难恢复计划，以防范和控制不可抗力因素造成的风险。

## 4. 基金运作的特有风险

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金，投资人投资于本基金还将面临以下特有风险。

### （1）基金份额的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

鼎利 A 份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普

通的债券型基金份额。虽然鼎利 A 份额具有相对稳定收益和本金保护的安排，但是约定收益的获得及其分配也具有不确定性，在本基金资产出现极端损失情况下，鼎利 A 份额仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

鼎利 B 份额表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额，类似于具有收益杠杆性的债券型基金份额。为避免鼎利 B 份额的份额净值跌到零，本基金采取了基金份额到点折算机制，但是如果市场出现极端下跌，鼎利 B 的份额净值依旧存在跌到零的风险。

## （2）基金的收益分配

本基金（包括中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额）将不进行收益分配。

根据基金合同的约定，在基金份额折算日，基金管理人将对鼎利 A 份额和鼎利 B 份额实施基金份额折算。鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的投资人可通过赎回鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的新增场内中欧鼎利份额的方式获取投资回报，但是，该获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资人不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额赎回的价格波动风险。

## （3）份额配对转换业务中存在的风险

本基金《基金合同》生效后，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理中欧鼎利份额与鼎利 A 份额、鼎利 B 份额之间的份额配对转换业务。一方面，这一业务的办理可能改变鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，这一业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

## （4）流动性风险

本基金的鼎利 A 份额与鼎利 B 份额在基金合同生效且符合上市交易条件后，在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

## （5）份额折算的风险

由于本基金各级基金份额的风险收益特征不同，当鼎利 A 份额和鼎利 B 份额

折算成中欧鼎利份额的场内份额及中欧鼎利份额的场内份额分拆成鼎利 A 份额和鼎利 B 份额后，或当鼎利 A 份额和鼎利 B 份额运作终止，鼎利 A 份额和鼎利 B 份额折算成中欧鼎利份额的场内份额后，基金份额持有人所持有基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

#### （6）基金份额的折/溢价交易风险

鼎利 A 份额与鼎利 B 份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。对于鼎利 A 份额、鼎利 B 份额，尽管在基金份额配对转换机制下，七份鼎利 A 份额与三份鼎利 B 份额的市价总和将与十份中欧鼎利份额的净值之间具有逼近的趋势，但是，鼎利 A 份额或鼎利 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于基金份额配对转换套利机制的影响，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的交易价格可能会相互影响，尤其是在临近份额配对转换业务的办理时点的时候。

## 二十四、基金合同的终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

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. 中国证监会规定的其他情况。

### （二）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

（1）自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算组，基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算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，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

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

## 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算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）根据基金合同终止日中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自净值分别计算中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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

基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 二十六、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

## 二十七、对基金份额持有人的服务

本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）基金份额持有人交易资料的寄送服务

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，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

### （二）在线服务

基金份额持有人可以通过本基金公司的网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### （三）查询与咨询服务

中欧基金公司客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，



基金份额持有人可通过客服电话 021-68609700, 400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录公司网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一至周五，9:00-17:00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

（四）投诉受理

基金份额持有人可拨打客服电话 021-68609700, 400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和代销机构的人员及其服务。

## 二十八、其他应披露事项

以下为本基金管理人自 2012 年 6 月 16 日至 2012 年 12 月 15 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

| 序号 | 公告事项  | 披露日期      |
|----|---|-----------|
| 1  | 中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金参与部分代销银行开展的基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 2012.6.18 |
| 2  | 中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金参与部分代销机构开展的电子渠道申购费率优惠活动的公告     | 2012.6.18 |
| 3  | 中欧基金管理有限公司旗下基金 2012 年 6 月 29 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告    | 2012.6.30 |
| 4  | 中欧基金管理有限公司旗下基金 2012 年 6 月 30 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告    | 2012.7.1  |
| 5  | 中欧基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告                    | 2012.7.5  |
| 6  | 中欧基金管理有限公司关于新增深圳众禄基金销售有限公司为旗下基金代销机构并实施费率优惠的公告             | 2012.7.13 |
| 7  | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳众禄基金销售有限公司开通基金转换业务的公告                | 2012.7.13 |
| 8  | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳众禄基金销售                               | 2012.7.13 |

|    |   |              |
|----|---|--------------|
|    | 有限公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告                  |              |
| 9  | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2012 年第 2 季度报告                      | 2012. 7. 19  |
| 10 | 中欧基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告     | 2012. 7. 19  |
| 11 | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书（2012 年第 2 号）                 | 2012. 7. 30  |
| 12 | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2012 年第 2 号）               | 2012. 7. 30  |
| 13 | 中欧基金管理有限公司关于新增华龙证券有限责任公司为旗下基金代销机构并同时开通定期定额投资业务的公告   | 2012. 8. 16  |
| 14 | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2012 年半年度报告（正文）                     | 2012. 8. 24  |
| 15 | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）                     | 2012. 8. 24  |
| 16 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告 | 2012. 8. 27  |
| 17 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告     | 2012. 8. 29  |
| 18 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告     | 2012. 8. 30  |
| 19 | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告     | 2012. 9. 19  |
| 20 | 中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 2012. 9. 22  |
| 21 | 中欧基金管理有限公司关于网上直销平台新增上海银联广发银行借记卡支付业务的公告              | 2012. 9. 27  |
| 22 | 中欧基金管理有限公司关于旗下基金在联讯证券有限责任公司开通基金转换业务的公告              | 2012. 10. 15 |
| 23 | 中欧基金管理有限公司关于新增联讯证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并参与费率优惠活动的公告     | 2012. 10. 15 |
| 24 | 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告                      | 2012. 10. 24 |

|    |  |              |
|----|--|--------------|
| 25 | 中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构的公告 | 2012. 11. 30 |
| 26 | 中欧基金管理有限公司关于网上直销平台开通支付宝基金专户支付业务并实施费率优惠的公告      | 2012. 12. 5  |
| 27 | 中欧基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告        | 2012. 12. 12 |

## 二十九、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金销售机构等办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 三十、备查文件

（一）备查文件包括：

1. 中国证监会批准中欧鼎利分级债券型证券投资基金募集的文件
2. 《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》
3. 《中欧鼎利分级债券型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》
4. 《中欧鼎利分级债券型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照
8. 中国证监会规定的其他文件

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2013年1月29日

## 附件一：基金合同摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利义务

#### （一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

邮政编码：200120

法定代表人：唐步

成立时间：2006年7月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监基金字[2006]102号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.2亿元人民币

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中信银行股份有限公司

住所：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：田国立

成立时间：1987年4月7日

批准设立文号：国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125号

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

### （三）基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

### （四）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理中欧鼎利份额申购和赎回申请；
8. 依据本基金合同的约定，转换本基金运作方式；
9. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
10. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
11. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

12. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

13. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

14. 依法召集基金份额持有人大会；

15. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （五）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7. 依法接受基金托管人的监督；

8. 计算并公告基金资产净值、中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后的份额转换比例；

9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；

10. 按规定受理中欧鼎利份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12. 编制季度、半年度和年度基金报告；

13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告

义务：

14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

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

17. 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；

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

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

20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （六）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其

他收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；
3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （七）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

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. 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；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交



割事宜；

11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额终止运作后的份额转换比例和中欧鼎利份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （八）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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. 依法转让其持有的鼎利 A 份额与鼎利 B 份额，依法申请赎回其持有的中欧鼎利份额，依法申请进行基金份额的配对转换；

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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### （九）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

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

（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

#### （二）召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或者单独或合计持有中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金总份额 10% 以

上（含10%，下同）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）就同一事项书面要求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，但中欧鼎利份额依据基金合同约定在封闭期结束后自动转为开放式运作除外；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）终止鼎利A份额与鼎利B份额的运作；
- （10）终止鼎利A份额与鼎利B份额上市交易，但因鼎利A份额与鼎利B份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- （11）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- （12）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更中欧鼎利份额的申购费率、调低赎回费率、变更或新增收费方式；
- （3）因相应的法律法规、证券交易所或注册登记机构规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）对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实质性变化；
- （5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### （三）召集人和召集方式

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

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

3. 单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 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. 单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

### （四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （五）基金份额持有人出席会议的方式

##### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式；

(2) 会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开；

(3) 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，如基金管理人

或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力；

（4）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；

（5）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### （1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%，下同）；

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

### （2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③ 召集人在监督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，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④ 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%

⑤ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代

理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## （六）议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 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就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（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：

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。

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）单独或合计代表权益登记日中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自基金份额 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，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

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

## 2. 议事程序

### （1）现场开会

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

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其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，则由出席大会的单独或合计代表中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自出席会议基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### （2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### （七）决议形成的条件、表决方式、程序

1. 中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### （1）一般决议

一般决议须经参加大会的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额表决权的 50% 以上通过方为有效；除下列 (2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

#### （2）特别决议



特别决议应当经参加大会的中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式（中欧鼎利份额依据基金合同约定在封闭期结束后自动转为开放式运作除外）、更换基金管理人或者基金托管人、终止鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的运作、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

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

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

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （八）计票

##### 1. 现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人或基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选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，由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如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。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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

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

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

（十）法律法规或监管部门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）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同将终止：

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. 中国证监会规定的其他情况。

## （二）基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

（1）自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算组，基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算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，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

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

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算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）根据基金合同终止日中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自净值分别计算中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在中欧鼎利份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议的解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，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。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、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。

## 附件二：托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

邮政编码：200120

法定代表人：唐步

成立日期：2006年7月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监基金字[2006]102号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

#### （二）基金托管人

名称：中信银行股份有限公司

住所：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：田国立

成立时间：1987年4月7日

批准设立文号：国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125号

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业

务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。

本基金可以从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的 3%。

中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

- ① 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%；
- ② 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

③ 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券，不超过该证券的10%；

④ 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%；

⑤ 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

⑥ 本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%，本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%；

⑦ 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

⑧ 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

⑨ 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%；

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 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；

⑫ 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；

⑬ 中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

⑭ 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%；

⑮ 法律法规或中国证监会规定的其他限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

（3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

（5）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保；

（3）从事可能使基金承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4. 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先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



的公司名单及有关关联方发行的证券名单及其更新，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人和基金托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后，变更一方应及时将变更信息发送对方，对方应于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

5. 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须及时通知基金托管人，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时，基金托

管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

（3）基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

#### 6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

（2）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（3）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关必要书面信息。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人。

（4）基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

（二）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、中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配（如有）、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。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人。

基金托管人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，并及时向中国证监会报告，基金管理人应依法承担相应责任。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须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。

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。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，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中欧鼎利份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的基金

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。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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，并予协助配合。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，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求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有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

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。未经基金管理人的正当指令，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，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，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管

基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

## （二）募集资金的验资

基金募集期间募集的资金应存于中国证券登记结算有限责任公司的开放式基金认购专户，该账户由基金管理人委托的登记结算机构开立并管理。

基金募集期满或基金提前结束募集时，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》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。同时，基金管理人应聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，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有效。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的有关规定。

## （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人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。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人

和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1. 《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，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2. 基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议生效之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券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上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，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或正本的复印件，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或正本的复印件。基金管理人在合同签署后 30 个工作日内通过

专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同送达基金托管人处。合同应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

## 五、基金资产净值计算与复核

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该计算日基金份额总份额后的数值。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，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》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中欧鼎利份额、鼎利A份额、鼎利B份额的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工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并以双方认可的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以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外予以公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人定期或不定期提交下列日期的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金托管人可以采用电子或文档的形式妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基

金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，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并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更和终止

### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2. 基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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