

# 中海量化策略股票型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请已于2009年4月29日获中国证监会证监许可【2009】347号文核准。

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

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人做出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 目 录

<b>一、绪 言</b> .....	<b>6</b>
<b>二、释 义</b> .....	<b>7</b>
<b>三、基金管理人</b> .....	<b>13</b>
(一) 基金管理人概况 .....	13
(二) 主要人员情况 .....	13
(三) 基金管理人的职责 .....	16
(四) 基金管理人的承诺 .....	17
(五) 基金经理的承诺 .....	17
(六) 基金管理人的风险管理和内部控制制度 .....	18
<b>四、基金托管人</b> .....	<b>23</b>
(一) 基金托管人概况 .....	23
(二) 主要人员情况 .....	24
(三) 基金托管业务经营情况 .....	24
(四) 基金托管人的内部控制制度 .....	24
(五) 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 .....	28
<b>五、相关服务机构</b> .....	<b>29</b>
(一) 销售机构 .....	29
(二) 注册登记机构 .....	42
(三) 出具法律意见书的律师事务所 .....	42
(四) 审计基金财产的会计师事务所 .....	42
<b>六、基金的募集</b> .....	<b>44</b>
(一) 募集的依据 .....	44
(二) 基金类型及基金存续期间 .....	44
(三) 募集方式 .....	44
(四) 募集期限 .....	44
(五) 募集对象 .....	44
(六) 募集场所 .....	45
(七) 募集目标 .....	45
(八) 基金份额的认购 .....	45
(九) 募集资金的管理 .....	47
<b>七、基金合同的生效</b> .....	<b>48</b>
(一) 基金备案的条件 .....	48
(二) 基金合同不能生效时募集资金的处理方式 .....	48
(三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和基金资产净值 .....	49
<b>八、基金份额的申购和赎回</b> .....	<b>50</b>

(一) 申购与赎回场所 .....	50
(二) 申购与赎回的开放日及时间 .....	50
(三) 申购与赎回的原则 .....	50
(四) 申购与赎回的程序 .....	51
(五) 申购与赎回的数额限制 .....	51
(六) 申购费用和赎回费用 .....	52
(七) 申购份额与赎回金额的计算 .....	53
(八) 申购和赎回的注册登记 .....	54
(九) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式 .....	55
(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 .....	55
(十一) 巨额赎回的情形及处理方式 .....	56
(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 .....	57
(十三) 基金的转换 .....	57
(十四) 基金的非交易过户 .....	58
(十五) 转托管 .....	58
(十六) 定期定额投资计划 .....	58
(十七) 其他情形 .....	59
<b>九、基金的投资 .....</b>	<b>60</b>
(一) 投资目标 .....	60
(二) 投资范围 .....	60
(三) 投资理念 .....	60
(四) 投资策略 .....	60
(五) 投资限制 .....	65
(六) 业绩比较基准 .....	67
(七) 风险收益特征 .....	67
(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法 .....	68
(九) 基金的融资、融券 .....	68
<b>十、基金的财产 .....</b>	<b>69</b>
(一) 基金资产总值 .....	69
(二) 基金资产净值 .....	69
(三) 基金财产的账户 .....	69
(四) 基金财产的处分 .....	70
<b>十一、基金资产的估值 .....</b>	<b>71</b>
(一) 估值日 .....	71
(二) 估值方法 .....	71
(三) 估值对象 .....	73
(四) 估值程序 .....	73
(五) 估值错误的处理 .....	73
(六) 暂停估值的情形 .....	75

(七)基金资产净值的确认 .....	76
(八)特殊情况的处理 .....	76
<b>十二、基金的收益与分配 .....</b>	<b>77</b>
(一)基金收益的构成 .....	77
(二)收益分配原则 .....	77
(三)收益分配方案 .....	78
(四)收益分配方案的确定、公告与实施 .....	78
(五)收益分配中发生的费用 .....	78
<b>十三、基金的费用与税收 .....</b>	<b>79</b>
<b>十四、基金的会计与审计 .....</b>	<b>82</b>
<b>十五、基金的信息披露 .....</b>	<b>83</b>
(一)信息披露义务人 .....	83
(二)本基金信息披露义务人信息披露承诺 .....	83
(三)本基金公开披露的信息应采用中文文本 .....	84
(四)信息披露的种类、披露时间和披露形式 .....	84
(五)信息披露事务管理 .....	87
(六)信息披露文件的存放与查阅 .....	88
<b>十六、风险揭示 .....</b>	<b>89</b>
<b>十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....</b>	<b>92</b>
(一)基金合同的变更 .....	92
(二)基金合同的终止 .....	93
(三)基金财产的清算 .....	93
<b>十八、基金合同的内容摘要 .....</b>	<b>95</b>
(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务 .....	95
(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则 .....	102
(三)基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	109
(四)争议的处理 .....	112
(五)基金合同存放地点和查询办法 .....	112
<b>十九、基金托管协议的内容摘要 .....</b>	<b>113</b>
(一) 托管协议当事人.....	113
(二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查 .....	114
(三) 基金财产保管 .....	122
(四) 基金资产净值计算和会计核算 .....	125
(五) 基金份额持有人名册的登记与保管 .....	125
(六) 争议解决方式 .....	126
(七) 托管协议的修改和终止 .....	127
<b>二十、对基金份额持有人的服务 .....</b>	<b>128</b>

(一) 持有人注册登记服务 .....	128
(二) 交易资料的寄送 .....	128
(三) 客户服务中心电话服务 .....	129
(四) 网上交易服务 .....	129
(五) 定期定额投资计划 .....	129
(六) 信息定制服务 .....	129
(七) 投资者投诉受理服务 .....	130
<b>二十一、招募说明书存放及查阅方式 .....</b>	<b>131</b>
<b>二十二、备查文件 .....</b>	<b>132</b>
(一) 备查文件目录 .....	132
(二) 存放地点 .....	132
(三) 查阅方式 .....	132

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）等相关法律法规和《中海量化策略股票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海量化策略股票型证券投资基金的投资目标、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。本基金根据本招募说明书所载明的资料申请募集。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称代表如下含义:

基金或本基金	指中海量化策略股票型证券投资基金。
基金管理人	指中海基金管理有限公司。
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司。
基金合同	指《中海量化策略股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充。
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中海量化策略股票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。
招募说明书	指《中海量化策略股票型证券投资基金招募说明书》,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,自基金合同生效之日起,每 6 个月更新 1 次,并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告,更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。
基金份额发售公告	指《中海量化策略股票型证券投资基金份额发售公告》。
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件。
《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作出的修订。



《销售办法》	指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及其不时作出的修订。
《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》及其不时作出的修订。
《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》及其不时作出的修订。
中国	指中华人民共和国，就招募说明书而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会或其地方派出机构。
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。
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。
个人投资者	合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会允许的其他可以投资证券投资基金的自然人。
机构投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额

	度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构。
投资人	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称。
基金份额持有人	指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资人。
基金销售业务	指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。
销售机构	指直销机构和代销机构。
直销机构	指中海基金管理有限公司。
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，代为办理基金销售业务的机构。
基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点。
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。
注册登记机构	指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中海基金管理有限公司或接受中海基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。
基金账户	指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户。
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基金份额的变动及结余情况的账

	户。
基金合同生效日	指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期。
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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期。
基金募集期限	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。
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限。
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。
日	指公历日。
月	指公历月。
T 日	指销售机构在规定时间受理投资人有效申请工作日。
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)。
开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期。
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。
认购	指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为。
申购	指在基金存续期内，投资人申请购买基金份额的行为。
赎回	指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为。
销售服务费	指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广

	销售以及基金份额持有人服务的费用。
基金转换	指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为。
转托管	指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施变更所持基金份额销售机构的操作。
巨额赎回	指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 10% 。
元	指人民币元。
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。
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。
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值。
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值。
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。
指定媒体	指中国证监会指定用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体。
不可抗力	指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行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、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

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

设立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：储晓明

总经理：康伟

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.3 亿元

联系人：夏立峰

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	46.923%
国联证券股份有限公司	37.692%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	15.385%

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

储晓明先生，董事长。香港大学工商管理硕士。现任中海信托股份有限公司总经理。历任中国工商银行评估部处长、风险管理部副总经理级干部，中海石油财务有限责任公司副总经理，中海信托股份有限公司常务副总经理。

成赤先生，董事。硕士。现任中国海洋石油总公司资金管理部总经理。历任中国海洋石油总公司计划资金部融资处处长，中国海洋石油有限公司资金融资部副总监。

陈浩鸣先生，董事。中央财经大学经济学硕士。现任中海信托股份有限公司副总经理。历任中国海洋石油总公司财务部资产处处长，中海石油投资控股有限公司总经理。

张志伟先生，董事。复旦大学EMBA。现任国联证券股份有限公司总裁。历任无锡国联发展（集团）有限公司金融管理部经理，国联证券股份有限公司投资银行部总经理，国联证券股份有限公司副总裁。

彭焰宝先生，董事。清华大学工学士。现任国联证券股份有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任国联证券股份有限公司交易员、投资经理、投资部副总经理，国联投资管理有限公司投资部总经理。2004年3月至2008年12月先后任本公司投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监。

温天先生，董事。硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司执行董事、上海代表处首席代表、中国地区负责人。2008年6月起，兼任爱德蒙得洛希尔银行旗下注册于卢森堡的私募股权基金Orient Express China Fund的董事。历任北京、上海主流新闻媒体财经节目负责人、记者、主编，上海银行支行负责人（短期）、部门总经理，华安基金管理有限公司高级研究员、产品部门负责人、市场部门负责人和公司战略总监等职。

夏斌先生，独立董事。硕士研究生，研究员，教授。现任国务院发展研究中心金融研究所所长。历任中国人民银行总行处长、副所长，中国证监会交易部主任兼信息部主任，深圳证券交易所总经理，中国人民银行非银行金融机构监管司司长。

陈瑛明先生，独立董事。硕士研究生。现任上海市瑛明律师事务所首席合伙人。历任香港史密夫律师行法律顾问，福建江成律师事务所合伙人，上海市新闵律师事务所专职律师。

李维森先生，独立董事。现任复旦大学经济学院经济学教授、博士生导师

师并任副院长。历任山东社会科学院《东岳论丛》编辑部编辑，澳大利亚麦角理大学经济学讲师。

## 2、监事会成员

朱恩惠女士，监事长。本科，会计师。现任中海信托股份有限公司资产托管部经理。曾任职于中信上海信托投资公司财务部。

Humbert GARREAU de LABARRE先生，监事。硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行高级副总裁。历任Neuflize, Schlumberger, Mallet 银行- 荷银集团资产组合经理，法国爱德蒙得洛希尔银行资产组合经理。

王红女士，监事。硕士。现任本公司总经理助理兼北京分公司总经理，历任辽宁省针棉毛织品进出口公司科员，北京中盛纸业有限公司总经理助理，北京大地投资有限公司市场营销部经理兼总经理助理，湘财证券有限责任公司北京办事处主任。

## 3、高级管理人员及督察长

康伟先生, 总经理。经济学学士。历任中兴信托上海总部研发部研究员、申银万国证券研究所市场研究部研究员、申银万国证券研究所策略研究部经理、中海信托股份有限公司总经理助理、副总经理。2007年7月至今任本公司总经理。

顾建国先生，副总经理。本科，高级经济师。历任中国人民保险公司上海分公司证券投资部副总经理，中国人寿保险公司上海分公司计划财务处副处长，中保信托上海证券业务部副总经理，中保信托上海地区总部总经理兼上海中山北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司上海中山北路营业部总经理。2004年3月至今任本公司副总经理。

方培池先生，副总经理。硕士。历任北京第二机床厂财务处主任科员，中华人民共和国轻工业部外事司财务处财务处长，中美轻工业合作基金管理公司首席财务专家，深圳海王集团有限公司总会计师，深圳海王生物有限责任公司副总经理，湘财证券有限责任公司市场总监并兼任监事。2005年3月进入本公司工作，任总经理助理兼北京管理总部总经理。2008年1月至今任本公司副总经理。



宋宇先生，督察长。本科，经济师。历任国联证券股份有限公司营业部副总经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月至今任本公司督察长。

#### 4、基金经理

李延刚先生，南京大学化学学士，加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理硕士，注册金融分析师（CFA），8年证券从业经历。历任中储发展股份有限公司海外业务发展助理、业务发展经理、战略发展总监，伦敦资产管理有限公司投资顾问、基金经理。2007年7月进入本公司工作，现任公司副总经理、投研中心总经理、中海分红增利混合型证券投资基金基金经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

康伟先生，主任委员，简历同上。

李延刚先生，委员，简历同上。

朱晓明先生，委员，毕业于上海交通大学管理学院，10年证券从业经历。历任上海上实资产管理有限公司资产管理部投资经理、高级投资经理，上实集团下属盛通投资管理顾问有限公司副总经理、董事副总经理。2006年7月起进入本公司工作，现任投研中心副总经理、投资总监、中海优质成长证券投资基金基金经理。

施恒新先生，委员，上海财经大学工商管理硕士，九年证券从业经历。历任国元证券、申银万国研究所，从事策略分析工作。2006年7月进入本公司工作，现任投研中心首席策略分析师、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度、半年度和年度基金报告。

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产。

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益。

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

#### （五）基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉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，  
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）基金管理人的风险管理和内部控制制度

### 1、内部控制体系概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管  
理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用  
管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效  
的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

### 2、风险管理的理念和文化

（1）以最大程度保护基金份额持有人利益为己任。

（2）风险管理是业务发展的保障。

（3）最高管理层承担最终责任。

（4）分工明确、相互制约的组织结构是前提。

（5）制度建设是基础。

（6）制度执行监督是保障。

### 3、内部控制遵循的原则

（1）健全性原则。内部控制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、部门和岗位职责保持相对独立，基金  
财产、公司自有资产、其他资产的运作分离。

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、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。

#### 4、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险控制组织体系至少应包括以下几个层面：一、董事会负责控制公司整体运营风险；二、公司高级管理层负责公司内部风险控制的领导及政策决定；三、风险管理部负责对业务风险进行日常管理；四、各职能部门负责对各自业务活动中潜在的风险通过执行制度进行控制。

(1) 董事会对内部风险控制负最终的责任。

董事会通过控制公司治理结构风险、制定内部管理制度、完善有关议事规则及充分发挥独立董事的作用达到对基金投资风险的最终控制。

风险控制委员会是董事会下设的专门委员会，主要职责有：审议基金资产风险状况评价分析报告，审定公司的业务授权方案的合法性、合规性，负责协调处理突发性重大事件并界定业务风险损失责任人的责任，审议公司其他各项资产管理业务的风险状况评价分析报告。其通过批准公司的风险控制战略、制度、工作计划和风险报告，确保公司具备能控制其在经营管理活动中所能认识的所有风险的必要系统、运作制度和控制环境。

(2) 高级管理层承担的风险管理工作主要有：组建公司风险管理部门，贯彻落实公司各项风险管理政策，监督检查下属部门的风控工作，发现问题并及时采取补救措施，定期向董事会汇报公司风险管理情况。

(3) 风险管理部为公司风控会下设的日常风险管理执行部门，其主要职责为：直接承担对公司经营管理和基金投资过程中发生风险的预警和控制职能，对有关风险提出分析报告并直接向风险控制委员会汇报工作。其具体职能有：对基金投资运作风险评估；新业务风险评估；投资风险指标监控和信用风险、流动性风险等的评估和监控等。

(4) 业务部门处于风险管理的前沿，是公司内部风险控制措施的具体执行部门，应该了解业务经营所承担的风险，所以业务部门应承担的职责是参与公司风险管理制度的制定和修改，严格遵守公司的各项制度和流程，并督导部门员工严格执行，保证开展业务的合法合规。

各部门、分支机构负责人是该部门、分支机构风险控制的第一责任人，

必须定期检查本部门的风险控制情况和风险控制措施是否有效。

#### 5、监督机构的合规检查作用

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵纪守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

#### 6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

（1）控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

（2）公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

（3）公司健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司合法权益。

（4）公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的

授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5) 公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

a、 各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

b、 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

c、 公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；

d、 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力；

e、 公司建立科学严密的风险评估体系，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；

f、 授权控制贯穿于公司经营活动的始终，通过完善法人治理结构、明确各部门职能与授权范围来完成；

g、 公司建立完善的资产分离制度，基金财产与公司资产、不同基金的财产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算；

h、 公司建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离；

i、 公司制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序；

j、 公司维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统；

k、 公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

## 6、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确。

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

组织形式：股份有限公司

联系人：蒋松云

联系电话：021-66105799

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务(银证转账)；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、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）主要人员情况

截至2008年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工117人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2008年12月，托管证券投资基金107只，其中封闭式8只，开放式99只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2008年初，中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财资》、《证券时报》和《上海证券报》等国际国内媒体评选为2007年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到12项。

## （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2007年，中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证 SAS70（审计标准第70号）。通过 SAS70 国际专项认证，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银

行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，已经启动 SAS70 审计年度化、常规化的项目。

### 1、内部控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务

部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和

岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资是否符合有关法律法规的规定及基金合同的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构：

（1）中海基金管理有限公司上海直销中心

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：储晓明

总经理：康伟

成立日期：2004 年 3 月 18 日

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788 或 021-38789788

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

（2）中海基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 F218

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：邹意

客户服务电话：400-888-9788 或 021-38789788

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

#### 2、代销机构：

（1）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系电话：010-66105799

传真：010-66105798

联系人：蒋松云

客户服务电话：95588

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

(2) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

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

(3) 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：郭树清

联系电话：010-66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

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

(4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

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

(5) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

传真：0755-83195049

联系人：王楠

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 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：孔丹

客户服务热线：95558

公司网址：bank.ecitic.com

(7) 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

客户服务热线：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(8) 深圳发展银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克·纽曼 (Frank N. Newman)

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

联系人：周勤

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(9) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市县前东街 168 号



办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：袁丽萍

客户服务电话：0510-82588168

公司网址：www.glsc.com.cn

(10) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(11) 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

电话：021-53831169

传真：021-53858549

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(12) 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 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：胡长生

电话：010-66568888

传真：010-66568536

联系人：李洋

客户服务电话：4008-888-888

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

(13) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-65178899

传真：010-65182261

联系人：魏明

客户服务电话：400-888-8108

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

(14) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666

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

(15) 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

联系人：王序微

客户服务电话：021-962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

（16）广发证券股份有限公司

住所：广东广州天河北路大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

（17）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市银城东路 139 号华能联合大厦 5 楼

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

（18）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳

客户服务电话：400-8888-123

公司网址：www.xyzq.com.cn

（19）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-950

传真：025-84579879

联系人：张小波

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（20）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：王益民

电话：021-62568800

传真：021-62569651

联系人：吴宇

客户服务电话：95503 或 4008-888-506

公司网址：www.dfzq.com.cn

（21）东吴证券有限责任公司

住所：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话:0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

（22）中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

联系人：王勤

客户服务电话:0571-96598

公司网址：www.96598.com.cn

（23）金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025695

传真：0755-83025625

联系人：张萍

客户服务电话：4008-888-228

公司网址：www.jyzq.cn

（24）东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660-8853

传真：021-50586660-8881

联系人：李涛

客户服务电话：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

（25）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：黄健

客户服务电话：4008-888-111

公司网址：www.newone.com.cn

（26）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：平岳

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：张静

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（27）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

电话：0755-22627802

传真：0755-82433794

联系人：袁月

客户服务电话：95511

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

(28) 联合证券有限责任公司

住所：深圳罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：4008-888-555，0755-25125666

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

(29) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 座 22-25 层

法定代表人：王珠林

电话：023-63786397

传真：023-63786767

联系人：杨卓颖

客户服务电话：400-8096-096

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

(30) 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 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：牛冠兴

电话：021-68801217

传真：021-68801210

联系人：张勤

客户服务电话：4008-001-001

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

(31) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：400-888-8788 或 10108998

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

(32) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

联系人：李昕田

客户服务热线：0931-4890619、4890618、4890100

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

(33) 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 层至 26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客户服务热线：95536

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

(34) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号



法定代表人：李玮

电话：0531-82024184

传真：0531-82024197

联系人：傅咏梅

客服电话：95538

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

（35）第一创业证券有限责任公司

住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26

层

法定代表人：刘学民

联系人：赵晖

电话：010-68055776

客户服务热线：0755-25832583

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

（36）万联证券有限责任公司

住所：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人：李舫金

电话：020-37865188

传真：020-37865008

联系人：刘广

客户服务热线：400-8888-133

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

（37）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京市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

联系人：李茂俊

电话：010-62294608-6240

传真：010-62296854

客户服务电话：4008-000-562

公司网站：www.hysec.com

（38）中国建银投资证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026507

传真：0755-82026539

联系人：刘权

客户服务电话：400-600-8008

公司网站：www.cjis.cn

（39）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：程维

客服电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（40）渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：www.bhzq.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称: 中海基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人: 储晓明

总经理: 康伟

成立日期: 2004 年 3 月 18 日

电话: 021-38429808

传真: 021-68419328

联系人: 曹伟

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所

住所: 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址: 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

法定代表人: 廖海

电话: 021-51150298

传真: 021-51150398

经办律师: 廖海、黎明

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 江苏公证天业会计师事务所有限公司(原江苏公证会计师事务所)

住所: 无锡市新区开发区旺庄路生活区

办公地址：无锡市梁溪路 28 号

法定代表人：张彩斌

电话：0510-85888988 85887801

传真：0510-85885275

经办注册会计师：沈岩、李建

## 六、基金的募集

### （一）募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关法律法规，并经中国证监会2009年4月29日证监许可[2009]347号文核准募集发售。

### （二）基金类型及基金存续期间

- 1、基金类型：股票型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金存续期间：不定期

### （三）募集方式

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

### （四）募集期限

自基金份额发售之日起，最长不超过3个月，具体发售时间以基金份额发售公告为准。

### （五）募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## （六）募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

## （七）募集目标

本基金不设定募集规模上限，基金管理人视募集情况可提前结束募集。

## （八）基金份额的认购

### 1、基金份额发售面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额发售面值：本基金基金份额发售面值为 1.00 元人民币，按发售面值发售。

### （2）认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，如下所示：

（单位：元）

认购金额 (M)	认购费率
$M < 100$ 万	1.20%
$100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	0.80%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

投资者重复认购，须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

### （3）认购份额的计算

本基金份额的发售面值为人民币 1.00 元，按发售面值发售。

本基金认购采取金额认购方式，认购份额的计算包括认购金额和认购金额在本基金募集期间产生的利息，其中利息以注册登记机构的记录为准，保

留小数点后两位。认购份额计算时采用四舍五入方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

本基金有效认购申请的认购费用及认购份额的计算统一采用外扣法，计算公式如下：

基金的认购金额包括认购费用和净认购金额，其中：

(一) 净认购金额=认购金额/（1+认购费率）。

(二) 认购费用=认购金额-净认购金额。

(三) 认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额发售面值。

## 2、认购的程序

### （1）认购时间安排

投资人认购本基金份额具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告。

### （2）投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

### （3）基金份额的认购采用金额认购方式

投资人认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资人在基金募集期内可多次认购，认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。投资人的认购申请一经受理不得撤销。

### （4）认购的确认

当日（T日）在规定时间内提交的申请，投资人通常可在T+2日到网点查询认购申请的受理结果，在基金合同生效后的2个工作日内可以到网点打印交易确认书。

### （5）认购金额的限制

通过本公司网站和代销机构首次认购单笔最低金额为人民币1000元；通过本公司直销柜台首次认购单笔最低金额为人民币100,000元，追加认购单笔最低金额为人民币10,000元。投资人在募集期内可以多次认购基金份额。

募集期间不设置投资人单个基金账户最高认购金额限制。

3、若基金合同生效，认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。认购利息折算的基金份额以四舍五入方式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，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。认购利息折成基金份额不收取认购费、不受最低认购份额限制。

#### （九）募集资金的管理

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。



## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金份额持有人不少于 200 的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

《基金合同》生效时，认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。基金募集期产生的利息以基金注册登记机构的记录为准。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

如果《基金合同》不能生效，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和基金资产净值

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购和赎回

### （一）申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。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。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购、赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信

息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间内向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

##### 3、申购和赎回的款项支付

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

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1、通过本公司网站和代销机构首次申购单笔最低金额为人民币 1,000 元；通过本公司直销柜台首次申购单笔最低金额为人民币 100,000 元，追加申购单笔最低金额为人民币 10,000 元；投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资人将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

3、投资人可多次申购，对单个投资人累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、投资人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔最低赎回份额为 100 份（除非该账户在销售机构或网点托管的基金份额余额不足 100 份）；若某笔赎回或转换导致持有人在销售机构或网点托管的基金份额余额少于 10 份，剩余部分基金份额必须一起赎回，即交易账户最低基金份额为 10 份。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购费用和赎回费用

1、本基金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。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，部分归入基金财产，其余用于市场推广、支付注册登记费和其他手续费，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

#### 3、申购费用

本基金申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

购买金额 (M)	申购费率
$M < 100$ 万	1.50%
$100 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	1.00%
$M \geq 500 \text{ 万}$	每笔 1000 元

#### 4、赎回费用

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定，赎回费率如下：

持有时间 (N)	赎回费率
N < 1 年	0.5%
1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，部分归入基金财产，其余用于市场推广、支付注册登记费和其他手续费，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

4、本基金的赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、本基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

##### 2、本基金赎回金额的计算：

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

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

3、本基金基金份额净值的计算：

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

4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### （八）申购和赎回的注册登记

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

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

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，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作。

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算。

（3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益。

（4）发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

（6）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

（4）发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按已被接受的单笔赎回申请量占已接受赎回申请总量的



比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定的媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站上公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（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总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下

一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》的有关规定通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并向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。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个或 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体公告。

#### （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

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日的基金份额净值。

#### （十三）基金的转换

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

#### （十四）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的可持有本基金份额的投资者的条件。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。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

#### （十五）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个销售机构的交易账户转入另一个销售机构的交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### （十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，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。

### （十七）其他情形

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

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

根据量化模型，精选个股，积极配置权重，谋求基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金投资范围限于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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品（如股指期货、期权等衍生品），基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资理念

以量化模型作为资产配置与构建投资组合的基础，以理性的积极投资管理获取长期的稳健收益。

### （四）投资策略

本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上，通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置，动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。同时，本基金运用现代金融工程技术，对各类宏观经济指标与股票市场的领先滞后关系与相关性进行分析，筛选出一组针对股票市场的宏观经济领先指标。此外，本基金将采用我公司的市场泡沫度模型（SMBMM, Stock Market Bubble Measure Model）定期计算股票市场的泡沫度，以度量市场情绪状况。这些宏观经济领先指标和市场泡沫度模型将用于辅助大类资产配置。

## 1、股票投资

本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略，施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。

首先，选取代表性最强的反映公司盈利能力的指标，主要包括过去三年平均 EPS、ROE、毛利率三项指标，对所有 A 股上市公司进行筛选从而得到一级股票库。

其次，在一级股票库初选的基础之上，本基金选取相应的盈利性指标、估值指标以及一致预期指标，基于熵值法确定各个指标权重，对一级库股票进行打分排名，从而筛选出二级股票库。其中，盈利性指标包括过去三年平均毛利率、EPS 及 ROE；估值指标包括 PE、PB、PS、PCF 及 PEG 等指标；一致预期指标包括 EG、RC、RA 及 EY 等指标。

在选股指标权重的确定上，以往对于选股指标权重的确定主要采用主观评定法或是简单等权法。“熵值法”动态赋权的特点在于可根据市场情况的变化而动态量化赋权，即若所有股票的某项选股指标差异度高，则该指标的权重就会相对较高；相反，若所有股票的某项指标差异度低，则该指标的权重就会相对较低。

最后，在行业权重配置方面，我们采用 Black-Litterman 模型（以下简称 BL 模型），结合市场均衡状态和一致预期数据计算出最优行业配置权重。结合 BL 模型给出的行业配置权重，我们确定股票组合每只股票的配置比例。

## 2、债券投资

债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

本基金债券投资组合资产配置采用自上而下的方法，个券选择采用自下而上的方法，具体债券资产配置、个券选择及投资流程如下：

(1) 债券资产配置方法：自上而下。

1) 根据利率变化趋势，确定债券投资组合的久期配置和风险管理方案。

利用中海宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置和风险管理方案。

2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析，选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3) 依据信用利差分析，对债券类别进行自上而下资产配置

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

(2) 个券选择方法：自下而上。

通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择基于相对价值和流动性进行。

普通债券上，本基金认为普通债券，包括国债、金融债、企业债和公司债的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并帮助找出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择投资于定价低估的债券品种。

企业债券类证券（包括企业债、公司债、可分离债的债券部分）是获得较高投资收益不可忽视的一部分，也是本基金在力争在低风险下获取较高收益时将采取的主要投资策略。本基金结合对宏观经济态势的判断与企业的盈利性、成长性评估债券的信用风险，本基金将在该风险评估基础上，依据对企业所处行业的研究以及企业自身发展与偿还能力的分析选择符合目标久期和资产配置需要的企业债券类证券以期获得高于基准的收益。

可转债品种上，本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资，着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行投资。

### （3）债券投资流程

具体流程上，本基金债券投资组合管理分为三个主要阶段：投资规划、投资实施、投资反馈调整阶段。按照以下步骤进行：

#### 第一阶段：投资规划

##### 1) 分析研究

研究发展部、固定收益部根据宏观经济数据，并跟踪中国人民银行及各部委的各项政策，研究各种政策的力度和影响，分析判断宏观经济变化趋势，确定市场利率变化方向，定期或不定期地出具债券市场研究报告。

##### 2) 投资计划

在上述研究的基础上，由基金经理结合市场情况，拟定投资计划，供投资决策委员会讨论。

##### 3) 资产配置策略

投资决策委员会定期召开会议，依据研究发展部、固定收益部、基金经理的研究分析报告，确定债券组合的久期等配置。

#### 第二阶段：投资实施

##### 4) 投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的资产配置策略，结合债券研究报告，确定券种的具体选择，并负责日常的维护和调整。

##### 5) 投资决策交易执行



交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行交易计划。在各种交易平台完成交易，并将交易结果反馈基金经理。

#### 第三阶段：投资反馈调整

##### 6) 投资组合动态调整

基金经理负责对投资组合进行动态调整。金融工程研究小组分析当前收益率曲线的形态，以及各市场之间的差异，发掘其中可能的套利机会，供基金经理参考，适时调整组合。

#### 3、资产支持证券投资

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，深入分析影响资产支持证券定价的多种因素，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。基于稳健投资规避信用风险，本基金只投资于信用评级为AAA的资产支持证券品种。

#### 4、权证投资

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，利用 Black-Scholes-Merton 模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，权证投资策略主要从价值投资的角度出发，采用如下策略进行权证投资：

##### (1) 套利投资策略

在权证和标的股票之间出现套利机会时，对权证进行套利投资。

##### (2) 风险锁定策略

根据认沽权证和标的股票之间的价差，在投资标的股票的时候，同时投资认沽权证，锁定投资风险。

##### (3) 股票替代策略

在价值投资的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，寻找溢价率低（甚至折价）的权证，利用权证替代股票，以期降低风险或提高潜在

收益。

由于权证市场的高波动性，本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险，寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。

#### （4）杠杆投资策略

对以根据量化模型所选品种为标的股票的权证进行模型定价研究，利用权证的杠杆效应，以期获得超额收益。

#### （五）投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

（3）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%。

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定。

（5）现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%

（6）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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用登记下降、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。

（7）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%。

（8）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%。

（9）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%。

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

(11) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整。

(12) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

(13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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。

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

2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券。

(2) 向他人贷款或者提供担保。

(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基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

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

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。

(8) 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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。因此业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。

本基金股票组合的业绩基准采用沪深300指数；本基金债券组合的业绩基准采用中国债券总指数。

沪深300指数于2005年4月正式发布，是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。沪深300指数的运行结果显示，该指数走势强于上证综合指数和深证综合指数。沪深300指数成份股为A股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于2003年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息

([www.chinabond.com.cn](http://www.chinabond.com.cn)) 上公开发布。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### (七) 风险收益特征

本基金属股票型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。
- 2、有利于基金资产的安全与增值。
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十、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。

其构成主要有：

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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



难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，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、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

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

### （五）估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

#### 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、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，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者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁

裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估。

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失。

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

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

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

2、因不可抗力或其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者的利益，决定延迟估值时。

4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况时。

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### (七)基金资产净值的确认

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工作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、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、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。

## 十二、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

本合同项下基金收益指基金利润，即基金利息收入、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）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金收益条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%，期末可供分配利润是指期末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。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、基金收益发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）不得超过 15 个工作日；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即指基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配后不能低于面值；

6、基金进行份额拆分后，将对拆分后的基金面值作相应调整，避免因于基金份额拆分为对基金份额持有人利益造成实质性不利影响；

7、每一基金份额享有同等分配权；

8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润(截至收益分配基准日的可供分配利润)、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

### （五）收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十三、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费。
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金的证券交易费用。
- 7、基金的银行汇划费用。
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金合同终止、基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。



## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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。
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用。
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的

有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

#### (六) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、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、基金管理人及基金托管人分别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、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，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，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 十五、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### （一）信息披露义务人

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。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证基金投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （二）本基金信息披露义务人信息披露承诺

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
- 2、对证券投资业绩进行预测。
- 3、违规承诺收益或者承担损失。
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构。
- 5、登载任何自然人、法人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。

### （三）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。

### （四）信息披露的种类、披露时间和披露形式

公开披露的基金信息包括：

#### 1、《招募说明书》、《基金合同》、基金托管协议

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

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的 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。

（2）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

#### 2、《发售公告》

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《发售公告》，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和基金管理人网站上。

#### 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

#### 4、基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和基金管理人网站上。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

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

#### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

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媒体上。

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媒体和网站上。

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，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的中国证监会派出机构备案。

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开。
- (2) 终止基金合同。
- (3) 转换基金运作方式。
- (4) 更换基金管理人、基金托管人。
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更。
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更。
- (7) 基金募集期延长。
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动。
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%。
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%。
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查。
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚。
- (14) 重大关联交易事项。
- (15) 基金收益分配事项。
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更。
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%。

- (18) 基金改聘会计师事务所。
- (19) 变更基金销售机构。
- (20) 更换基金注册登记机构。
- (21) 本基金开始办理申购、赎回。
- (22) 本基金赎回费率及其收费方式发生变更。
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付。
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请。
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回。
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

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

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

## 10、中国证监会规定的其他信息。

### （五）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金



信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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

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

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

《招募说明书》公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

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。

基金管理人与基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十六、风险揭示

基金风险按来源主要分为系统性风险、非系统性风险、基金管理风险和本基金特有风险。本基金本着科学、严谨的原则，对风险的识别、评估和控制的全过程进行管理。

### （一）系统性风险

系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对股票、债券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险等。

#### 1、政策风险

指货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规变化对证券市场产生的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行周期性的变化会对证券的基本面产生影响，导致证券价格变化而产生的风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场及债券市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

#### 4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

#### 5、汇率风险

汇率变动可能会影响基金所投资证券的价格和基金资产的实际购买力。

#### 6、其它风险

因战争、自然灾害等不可抗力产生的风险。

## （二）非系统性风险

非系统性风险是指单个证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。

上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资股票和债券的发行人经营不善，导致其股票价格下跌、股息、红利减少，或者存在所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

基金可以通过多样化投资以及严格的信用风险评估机制来分散或者规避这种非系统性风险。

## （三）基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括基金产品风险、管理风险、流动性风险、交易风险、运营风险及道德风险。

### 1、基金产品风险

本基金作为主动型的混合型基金，在具体投资管理中股票仓位保持在30%-95%之间，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)仓位保持在0%—65%之间，因此本基金兼有股票市场和债券市场的风险。

### 2、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准的风险。对主要业务人员（如基金经理）的依赖也可能产生管理风险。本基金管理人和基金托管人因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善，也构成了本基金的管理风险。

### 3、流动性风险

本基金为契约型开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断波动。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合

持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

#### 4、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

#### 5、运营风险

由于运营系统（网络系统、计算机、交易软件等）发生技术故障等情况，而无法正常工作完成基金的申购、赎回、注册登记、清算交收等指令；由于操作过程效率低下或人为错误产生的操作风险。

#### 6、道德风险

因业务人员行为违规产生的道德风险，如内幕交易、欺诈等。

#### （四）本基金特有风险

本基金是一只积极投资的股票基金，主要通过数量模型选择股票并构建投资组合，由于上市公司财务数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，可能导致数量模型对股票收益率的预期产生偏差，从而给本基金的股票选择带来风险。

由于本基金资产配置比例相对固定，且股票资产比例较高，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

本基金作为量化策略基金，非常依赖相关数据的准确性和可靠性。个别研究报告数据是否准确与可靠是本基金的特有风险，将对本基金的业绩表现有所影响。因此，采用反映市场综合研究数据的一致预期指标能一定程度上规避个别研究报告数据带来的准确性与可靠性风险。

## 十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）更换基金管理人。

（2）更换基金托管人。

（3）转换基金运作方式。

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费用标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准或费用的除外。

（5）变更基金类别。

（6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）。

（7）本基金与其他基金的合并。

（8）变更基金份额持有人大会召开程序。

（9）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费。

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取。

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率。

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改。

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化。

（6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准

生效后方可执行，基金管理人应在自中国证监会核准之日起2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的。
- 2、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的。
- 3、基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的。
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算小组

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

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

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

### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产。
- （2）对基金财产进行清理和确认。
- （3）对基金财产进行估值和变现。
- （4）制作清算报告。
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计。
- （6）聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。
- （7）将基金清算报告报中国证监会备案。
- （8）公布基金清算报告。

(9) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

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

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十八、基金合同的内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

投资人自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益。
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产。
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额。
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会。
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权。
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料。
- （7）监督基金管理人的投资运作。
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金份额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。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）遵守基金合同。



(2) 缴纳基金认购、申购赎回款项及法律法规、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) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利。

(6) 执行生效的基金份额持有人大会决议。

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

基金管理人的权利：

(1) 依法募集基金。

(2) 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产。

(3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他收入。

(4) 销售基金份额。

(5) 召集基金份额持有人大会。

(6) 依据基金合同及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益。

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人。

(8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理。

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用。

(10) 依据基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案。

(11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请。

(12) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整业务规则，决定和调整除调高管理费和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式。

(13) 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。

(14) 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。

(15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

(16) 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。

(17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 基金管理人的义务：

(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，如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护投资者的利益。

(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，不得利用基金财产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) 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,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格。
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告。
- (11) 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。
- (12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露。
- (13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益。
- (14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项。
- (15) 依据基金法、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会。
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上。
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件。
- (18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。
- (19) 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。
- (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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除。
- (21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基

金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿。

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿。

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人。

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

基金托管人的权利：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产。

(2) 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。

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益。

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

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清

算。

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算。

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会。

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人。

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

基金托管人的义务：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产。

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、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) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

(4) 除依据基金法、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产。

(5) 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，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。

(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予以保密，不得向他人泄露。

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格。

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。

(10) 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。

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上。

(12) 建立并保存基金份额持有人名册。

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对。

(14) 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。

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会。

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作。

(17) 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。

(18) 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监管机构，并通知基金管理人。

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿。

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

4、本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 2、召开事由

（1）当出现或需决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- a、终止基金合同。
- b、更换基金管理人。
- c、更换基金托管人。
- d、转换基金运作方式。
- e、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费用标准，但法律法规要求提高该等报酬标准或费用的除外。

f、变更基金类别。

g、本基金与其他基金的合并。

h、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）。

i、变更基金份额持有人大会程序。

j、对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

k、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（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，不需召开基金份额持有人大会：

a、调低基金管理费、基金托管费。

b、法律法规要求增加的基金费用的收取。

c、在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率。

d、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改。

e、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。

f、除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

### 3、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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）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。

(5) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30



日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 4、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) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- a、 会议召开的时间、地点、方式和会议形式。
- b、 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式。
- c、 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日。
- d、 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。
- e、 会务常设联系人姓名及联系电话。
- f、 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，由会议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、书面表达意见的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。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

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。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

a、亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

b、经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%(含 50%)。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

a、会议召集人按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。

b、会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力。

c、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%(含 50%)。

d、上述第 c 项中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,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

e、会议通知公布前报中国证监会备案。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

b、 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人

提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获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。法律法规另有规定除外。

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### a、现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### b、通讯方式开会

在通讯开会的情况下，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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### a、一般决议

一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项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。

#### b、特别决议

特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持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、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

### 8、计票

#### (1) 现场开会

a、如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

b、监票人应当在基金份额持有人或代理人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

c、如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有异议，

可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

d、计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

## 9、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的决议，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。

(2) 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。

(3) 基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(4) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

(5) 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。

(6) 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) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、基金合同的变更

(1) 以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- a、 更换基金管理人。
- b、 更换基金托管人。
- c、 转换基金运作方式。
- d、 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费用标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准或费用的除外。
- e、 变更基金类别。
- f、 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）。
- g、 本基金与其他基金的合并。
- h、 变更基金份额持有人大会召开程序。
- i、 终止基金合同。
- j、 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后并公告，并报中国证监会备案：

- a、 调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费。
- b、 法律法规要求增加的基金费用的收取。
- c、 在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的赎回费率。
- d、 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改。
- e、 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。
- f、 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（2）关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行。基金合同人应在自基金合同生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

## 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的。

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的。

(3) 基金合同约定的其他情形。

(4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

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

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

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

(4) 基金财产清算程序

a、 基金合同终止时，由基金财产清算小组统一接管基金。

b、 对基金财产和债权债务进行清理和确认。

c、 对基金财产进行估值和变现。

d、 制作清算报告。

e、 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。

f、 将清算报告报中国证监会备案并公告。

g、 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月

(6) 清算费用

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

(7) 基金财产清算剩余资产的分配



依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （8）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金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小组进行公告。

#### （9）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）争议的处理

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

基金合同受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地点和查询办法

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### （一） 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：储晓明

成立时间：2004 年 3 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]24 号文

注册资本：壹亿叁千万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资金：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理

票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、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）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

#### （1）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

a、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：

本基金投资范围限于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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品（如股指期货、期权等衍生品），基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

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：

本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的 60%—95%，

债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

b、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。

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：

- 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%。
- 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。
- 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%。
- 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 现金或到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%。
- 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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用登记下降、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；
- 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超

过该资产支持证券规模的10%。

- 本基金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%。
- 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%。
- 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。
- 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；
- 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资比例的约定。
- 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

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和检查自本基金合同生效之日起开始。

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

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

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。

c、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：

- 承销证券。
- 向他人贷款或提供担保。
- 从事承担无限责任的投资。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。

d、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交易限制进行监督。

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其更新，加盖公章并书面提交，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。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已收到变更后的名单。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，并造成基金损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与上述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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

e、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。

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 1 个工作日内回函对名单确认。基金管理人收到基金托管人书面确认后，名单开始生效。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向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 1 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，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

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，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。

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。

f、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

g、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

- 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证券行为的紧急通知》、《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。
- 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
- 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基金管理人董事会批准的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。

- 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书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占基金资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息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，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。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。如果基金托管人已切实履行监督职责，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。

(2) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表

现数据等进行监督和核查。

(3)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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反基金合同而致使投资者遭受的损失。

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，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并报告中国证监会。

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律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。

## 2、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。

### （三）基金财产保管

#### 1、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）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进

行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

## 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的中海基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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，由基金管理人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。验资完成，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。

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。

## 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

## 4、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责任公司上海分公司/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本基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

#### 5、债券托管帐户的开设和管理

(1)《基金合同》生效后，基金管理人负责以本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，并代表本基金进行交易；基金托管人负责以本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自营账户，并由基金托管人负责本基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金托管人和基金管理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。

#### 6、其他账户的开立和管理

在本托管协议订立日之后，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，由基金管理人协助基金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。

#### 7、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。属于基金托管人实际有效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。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表本基金签署的与本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，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以

便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件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。

#### （四）基金资产净值计算和会计核算

基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

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资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

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公布的基金资产净值的计算结果予以公布。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。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

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，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日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提交下列日期的基金份额持有人名册：基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日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。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，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。

#### （六）争议解决方式

双方同意，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，仲裁的地点在北京，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。

## （七）托管协议的修改和终止

### 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、破产或有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、破产或有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。



## 二十、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并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）持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金管理人将敦促基金注册登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；权益分配时红利的登记派发；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的2个工作日后（T+2 日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的2个工作日后（T+2 日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、基金交易对账单的寄送频率为经济寄送，即有交易发生就寄送该季度的对账单。且不论是否发生交易，每年对基金份额持有人寄送一次对账单（要求不予寄送的除外）。季度对账单于每季结束后20个工作日内送达，记录基金持有人最近一季度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户余额等。每年度结束后30个工

作日内，向所有份额持有人送达账户状况对账单。

### （三）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询、基金产品与传真服务等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于8小时的人工热线咨询服务。持有人可通过客服热线电话：400-888-9788或021-38789788享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### （四）网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。凡持有兴业银行、浦发银行、中信银行、招商银行、中国建设银行和中国农业银行借记卡的投资者，可以直接登录基金管理人网站[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)办理“网上开户”和“网上交易”业务。

在技术条件成熟时，基金管理人还将提供支持其他银行卡种的网上交易业务。

### （五）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### （六）信息定制服务

基金持有人可以登录拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定制提供信息。可定制的信息包括：每日基金净值、交易确认信息、投资者服务刊物、分红公告、

公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

#### （七）投资者投诉受理服务

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、基金管理人网站留言栏目、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉、网站留言是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务中心负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的24小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务中心邮箱：[service@zhfund.com](mailto:service@zhfund.com)

## 二十一、招募说明书存放及查阅方式

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

投资人还可以直接登录基金管理人的网站([www.zhfund.com](http://www.zhfund.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十二、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准中海量化策略股票型证券投资基金募集的文件。
- 2、《中海量化策略股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《中海量化策略股票型证券投资基金托管协议》。
- 4、关于申请募集中海量化策略股票型证券投资基金法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### （三）查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

中海基金管理有限公司  
二〇〇九年五月十五日