

# 博时价值增长贰号证券投资基金 招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二零零六年八月

## 【重要提示】

本基金经 2006 年 8 月 24 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】174 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本招募说明书。

过往业绩并不代表将来业绩。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。

### 特别提示：

#### 1、博时价值增长贰号证券投资基金的说明

本基金是博时价值增长证券投资基金的复制产品，博时价值增长证券投资基金是博时基金管理公司管理的第一只开放式证券投资基金，于 2002 年 10 月 9 日成立，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。截至 2006 年 6 月 30 日，该基金份额净值累计达到 1.684 元，平均年份净值增长率 18.24%。基金规模长期稳定在 25 亿元左右；该基金自成立至今，实施了 5 次分红，每 10 份基金份额累计分红金额达到 1.98 元。

本基金与博时价值增长证券投资基金采用相同的投资目标、投资策略和投资理念，但在投资运作上完全独立。博时价值增长证券投资基金的过往业绩不预示本基金的未来表现。本基金与博时价值增长证券投资基金的未来业绩可能存在差异。

#### 2、提醒投资人正确理解价值增长线

(1) 价值增长线与基金份额净值是两个不同的概念

开放式基金的基金份额净值是投资人申购、赎回基金份额时的计价基础，而价值增长线

则是基金管理人为约束自身的投资风险，而自设的一个风险控制目标。价值增长线不是实际的基金份额净值，只是基金管理人力争保证的价值水平。

#### (2) 价值增长线不是保底收益承诺

价值增长线既不是基金投资人的实际收益，也不是基金管理人的保底收益承诺，而是基金管理人力争保证的价值水平。基金份额净值在大概率上会在价值增长线之上，但也不能完全排除小概率事件发生的风险，即基金份额净值跌破价值增长线的可能。

#### (3) 金融技术风险揭示

本基金在投资管理和风险管理中采用了组合保险和风险预算管理 (VaR) 的金融工程技术，并经过严密的过程控制，但依然不能保证基金份额净值在任何时候均不跌破价值增长线。

#### (4) 价值增长线的披露

价值增长线数值是由基金管理人计算，并经过基金托管人核对无误后，由基金管理人公开发布。

基金托管人是独立于基金管理人的、经中国人民银行和中国证监会审查批准的商业银行。本基金的基金份额净值是由基金管理人计算，并由基金托管人核对无误后，由基金管理人公开发布；同时，根据本基金产品的特点，为保证价值增长线计算的准确和公允，基金管理人计算的价值增长线数值也是由基金托管人核对无误后，由基金管理人将其与基金份额净值一起同时对外公布。

#### (6) 价值增长线计算方法

基金管理人在本基金合同中明确公布了价值增长线的计算方法，由于计算方法简便透明，投资人可自行计算，并与公布值随时核对。

需要特别说明的是，价值增长线固定周期（按日历计算的每 180 天）进行调整。本基金自基金开放日起的第一个日历日 180 天（第一期）内，价值增长线数值设为恒值 0.900 元；

第一期结束后，即从日历日的第 181 天起，本基金将开始按照已公布的价值增长线计算公式定期计算。

(7) 价值增长线计算的差错处理

当价值增长线计算差错明确为基金管理人责任时，基金管理人承诺采用最有利于基金份额持有人的结果（一般为最大值）并对外公告。

## 目 录

一、绪言.....	6
二、释义.....	6
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	18
五、相关服务机构.....	21
六、基金的募集.....	29
七、基金合同的生效.....	32
八、基金份额的申购与赎回.....	33
九、基金的投资.....	41
十、基金的财产.....	47
十一、基金资产的估值.....	48
十二、基金收益与分配.....	52
十三、基金的费用与税收.....	53
十四、基金的会计与审计.....	55
十五、基金的信息披露.....	55
十六、风险揭示.....	60
十七、基金合同的终止与基金财产的清算.....	61
十八、基金合同内容摘要.....	63
十九、托管协议的内容摘要.....	75
二十、对基金份额持有人的服务.....	86
二十一、其他事项.....	89
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	89
二十三、备查文件.....	89

## 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他相关法律法规的规定以及《博时价值增长贰号证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资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：指博时价值增长贰号证券投资基金
2. 基金管理人或本基金管理人：指博时基金管理有限公司
3. 基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《博时价值增长贰号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《博时价值增长贰号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《博时价值增长贰号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
7. 基金份额发售公告：指《博时价值增长贰号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、司法解释、行政规章以及

其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9. 《证券法》：指 2005 年 10 月 27 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议通过，自 2006 年 1 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订

10. 《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

11. 《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》及颁布机关对其不时作出的修订

12. 《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作出的修订

13. 《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作出的修订

14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15. 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

16. 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

17. 个人投资者：指年满 18 周岁，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，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的其他自然人

18. 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

19. 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》规定的条件，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

20. 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者的合称

21. 基金份额持有人：指依基金合同或招募说明书合法取得基金份额的投资人

22. 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

23. 销售机构：指直销机构和代销机构

24. 直销机构：指博时基金管理有限公司

25. 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

26. 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

27. 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

28. 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博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

29. 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

30. 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博时价值增长贰号证券投资基金基金份额的变动及结余情况的账户

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

32. 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，中国证监会对清算结果核准并予以公告的日期

33. 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

34. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35. 日/天：指公历日

36. 月：指公历月

37. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38. T 日：指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期

39. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

40. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41. 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，具体时间见基金份额发售公告

42. 业务规则：指《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所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

43. 认购：指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为

44. 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基金份额的行为

45. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为

46. 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有效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

47. 转托管：指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作

48. 巨额赎回：本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时

49. 元：指人民币元

50. 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

51. 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

52. 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

53. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数

55. 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

56. 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

57. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免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、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

基金管理人名称：博时基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人：吴雄伟

成立时间：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]26 号

注册资本：壹亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：发起设立基金、基金管理

存续期间：持续经营

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。公司股东为金信信托投资股份有限公司，持有股份 48%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；招商证券股份有限公司，持有股份 25%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。公司注册资本为 1 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设十三个部门，分别是：市场部、股票投资部、产品规划部、固定收益部、养老金业务部、研究部、交易部、财务部、信息技术部、监察法律部、人力资源部、基金运作部、总裁办公室。市场部从事基金营销策划、渠道沟通、国际业务开发等工作。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。产品规划部负责新产品设计、产品维护和业绩分析等。固定收益部负责进行固定收益证券的选择和组合管理。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和

服务等工作。研究部负责完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。财务部负责公司财务事宜。信息技术部负责系统开发、网络运行及维护。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。总裁办公室专门负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、外事活动管理、档案管理、董事会、党办及工会工作。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、人事信息管理工作。基金运作部负责基金会计、基金注册登记、直销及客户服务业务。另设北京分公司、上海分公司和南方大区，分别负责北方、华东、华中地区和华南地区的基金销售和服务支持工作。此外还建立了企业年金顾问团，负责为客户提供企业年金方案设计方面的顾问服务。

截止到 2006 年 5 月 17 日，总人数 176 人，其中 64.2% 以上的员工具有硕士及以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## （二）主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

吴雄伟先生，董事长，博士学历，经济师。历任金信信托投资股份有限公司（原金华信托）总经理办公室主任、研究发展中心主任、总经理助理、基金管理总部总经理、公司副总经理。现任博时基金管理有限公司董事长。

肖风先生，副董事长，博士学历。历任深圳康佳电子集团股份有限公司董事会秘书兼股证委员会主任，中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处科长、副处长，深圳市证券管理办公室副处长、处长，证管办副主任。现任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。

杨静女士，董事，经济学硕士，高级经济师。1992 年进入证券行业，历任招商银行证券业务部（招商证券前身）总经理助理、招商证券副总裁，先后分管招商证券的经纪、电脑、财务、电子商务、研究等业务工作。现任招商证券副总裁，兼任中国国债协会第二届理事会常务理事，深圳证券业协会常务副理事长。

夏永平女士，董事，经济学硕士，高级经济师。历任中国农业银行总行人事部劳资处主

任科员、副处长、处长，中国长城信托投资公司总裁助理、副总裁。现任中国长城资产管理公司工会委员会副主任委员。

汪晓峰先生，董事，经济学学士。曾就职于加拿大多伦多大学亚太经济研究中心、JP 摩根（纽约总部）投资管理研究中心、Dearborn Financial Institute 亚洲区、Pacific World Asset Management Limited 亚太区、香港新鸿基国际有限公司、金信信托投资股份有限公司。

陈小鲁先生，独立董事，高级经济师。历任中华人民共和国驻英国大使馆国防副武官，北京国际战略问题研究学会副秘书长，原中共中央政治体制改革研究室局长，亚龙湾开发股份有限公司总经理。现任标准国际投资管理公司董事长。

赵榆江女士，独立董事，经济学硕士。历任国家经济体制改革委员会研究员，英国高诚证券（香港）有限公司董事，北京代表处首席代表，法国兴业证券（香港）有限公司董事总经理。现任康联马洪（中国）投资管理有限公司董事、高级投资顾问。

姚钢先生，独立董事，经济学硕士，研究员（教授）。历任中国社会科学院农村发展研究所副研究员，海南汇通国际信托投资公司证券业务部副总经理，深圳证券交易所上市委员会委员，深圳证券商协会副主席，中国证券机构部顾问。现任中国社会科学院经济文化研究中心副主任。

## 2、基金管理人监事会成员

王金宝先生，监事，硕士学历。曾任贵州证券公司上海业务部交易部经理、招商证券股份有限公司上海澳门路证券营业部总经理，现任招商证券股份有限公司证券投资部总经理。

包志涛先生，监事，经济学学士，高级经济师。历任中国农业银行信托投资公司业务一部副经理、信托业务部副经理、中国长城信托投资公司资产保全部总经理，现任中国长城资产管理公司债权管理部债权维护处处长。

黄家华先生，监事，商贸学士。历任益高证券及金融有限公司信贷监控员、邓百氏（香港）有限公司市场推广顾问、瑞士丰泰私人金融服务有限公司高级投资顾问经理、标准人寿亚洲（香港）有限公司高级投资策划顾问、Associe Financiere Global Asset Management Ltd.，行政总监、新鸿基优越理财有限公司董事总经理、金信信托投资股份有限公司董事会风险控制委员会委员。

尹庆军先生，监事，硕士。历任中央编译局世界所助理研究员；中央编译局办公厅秘书

处科研外事秘书；中央编译出版社出版部主任。1999年1月12日加入博时基金管理有限公司，曾任行政管理部人力资源经理、行政与人力资源部总经理，现任人力资源部总经理。

### 3、公司高管人员

吴雄伟先生，董事长，博士学历，经济师。历任金信信托投资股份有限公司（原金华信托）总经理办公室主任、研究发展中心主任、总经理助理、基金管理总部总经理、公司副总经理。现任博时基金管理有限公司董事长。

肖风先生，副董事长兼总经理，博士学历。历任深圳康佳电子集团股份有限公司董事会秘书兼股证委员会主任，中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处科长、副处长，深圳市证券管理办公室副处长、处长，证管办副主任。现任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。

李全先生，副总经理。1988年7月毕业于中国人民银行总行研究生部。1988年在中国人民银行总行金融研究所工作，同年进入中国农村信托投资公司。1991年进入正大国际财务有限公司工作，历任北京代表处首席代表、资金部总经理、总经理助理。1998年5月加入博时基金管理有限公司，任督察员兼监察部经理。2000年至2001年，在梅隆信托的伦敦总部及其下属牛顿基金管理公司工作。2001年4月，回到博时任副总经理，主管公司投资业务。2003年起主管公司运作部门和市场发展部门。李全先生还在新华富时指数委员会担任委员。

何绰越先生，投资总监兼国际业务总监。学士学位，毕业于香港大学。1993年11月至1997年4月于里昂证券工作，先后任中国研究部主管与中国、韩国以及台湾股票管理事务负责人；1997年5月至1998年12月在瑞银华宝工作，担任香港及中国股票部主管、交易主管；1999年2月至2000年1月在汇丰证券工作，担任大中华地区销售和研部主管；2000年2月至2001年12月在汉宇资本工作，任首席执行官；2002年2月至2002年11月在中银国际工作，任研究部董事总经理；2003年5月至2006年2月创办中信投资研究，任董事总经理。2006年4月入职博时基金管理有限公司，担任投资总监兼国际业务总监。

刘纯亮先生，督察长兼监察法律部总经理。1993年7月毕业于中央民族学院经济系金融专业。1996年加入中国注册会计师协会，1998年成为特许公认会计师公会（ACCA）会员。曾就职于北京建工集团金融中心、柏德豪关黄陈方国际会计师行（BDO）、中国证券监督管理委员会、英国毕马威会计师事务所（KPMG）等单位。2001年11月加入博时基金管理有限公司。

任督察长兼监察部总经理。

#### 4、本基金基金经理

肖华先生，1993年同济大学硕士毕业，并在复旦大学中美经济学培训中心（福特班）学习1年。1993年先后在华为技术公司、中国深圳宝安集团股份有限公司工作。1994年1月至1999年3月于君安证券有限公司工作，历任君安资产管理有限公司项目经理、投资部经理、基金部经理、上海中华实业股份有限公司任总经理助理、副总经理（主管投资）。2000年5月至2002年5月于长盛基金管理有限公司任基金同盛基金经理。2002年5月28日入博时基金管理有限公司，任股票投资部部门经理。2002年10月起兼任博时价值增长基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：何焯越； 委员：李全，肖华，杨锐，蔡冬亮，温宇峰，方维玲，邵凯。

肖华先生，1993年同济大学硕士毕业，并在复旦大学中美经济学培训中心（福特班）学习1年。1993年先后在华为技术公司、中国深圳宝安集团股份有限公司工作。1994年1月至1999年3月于君安证券有限公司工作，历任君安资产管理有限公司项目经理、投资部经理、基金部经理、上海中华实业股份有限公司任总经理助理、副总经理（主管投资）。2000年5月至2002年5月于长盛基金管理有限公司任基金同盛基金经理。2002年5月28日入博时基金管理有限公司，任股票投资部部门经理。2002年10月起兼任博时价值增长基金经理。

杨锐先生，1972年出生，博士。1999年7月毕业于南开大学国际经济研究所，获经济学博士学位。1999年8月入博时基金管理有限公司，任研究部策略分析师；2002年10月起兼任博时价值增长基金基金经理助理。2004年6月起担任研究部副总经理兼策略分析师。2005年1月至2006年1月由博时公司派往纽约大学 Stern 商学院做访问学者。2005年6月至2006年1月在 AllianceBernstein 的股票投资部门工作。2006年1月回国继续担任研究部副总经理、策略分析师，5月起兼任博时平衡配置基金经理。

蔡冬亮先生，学士。1997年毕业于中央财经大学国际企业管理专业，获学士学位。1997年至2001年先后在君安证券总裁办公室、国泰君安证券蔡屋围营业部工作。2001年6月入博时基金管理有限公司，任交易部高级交易员，2003年9月起任交易部负责人；2004年9月起任交易部总经理。

温宇峰先生，1991年毕业于西南财经大学，获经济学学士学位；1994年毕业于中国人民银行总行研究生部，获经济学硕士学位；1999年毕业于芝加哥大学，获得工商管理硕士学位；CFA。1994年至1997年，在中国证监会发行部工作，任主任科员；2000年2月至8月，任中

银国际控股有限公司投资银行部副总裁；2000年10月加入博时基金管理有限公司，任研究部研究员，并于2002年11月起担任研究部副总经理；2004年6月到2005年2月，任上投摩根富林明基金管理有限公司研究总监；2005年4月，加入博时基金管理有限公司，任研究部副总经理。

方维玲女士，经济学、理学双硕士。曾在云南大学数学系学习，先后获得理学学士和硕士学位，曾在财政部科研院所学习财政金融专业，获得经济学硕士学位。曾先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、湘财证券有限责任公司海口营业部、北京玖方量子软件技术有限公司任职。2001年3月入博时基金管理有限公司，数量化投资部任金融工程师。2004年7月任数量化投资部副总经理。2006年8月23日起任产品规划部总经理。

邵凯先生，经济学硕士。1993年9月至1997年7月在中央财经大学投资经济管理专业学习，获学士学位。1997年8月至1999年8月在河北省经济开发投资公司投资管理部工作。1999年9月至2000年7月毕业于英国READING大学学习国际证券与投资银行专业，获硕士学位。2000年8月入博时基金管理有限公司，曾任基金管理部债券组合经理助理、基金管理部债券组合经理、固定收益部债券投资经理；2003年6月起任社保债券基金基金经理。2005年5月起担任固定收益部副总经理。

### （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. 编制中期和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

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、受雇人或任何第三者谋取利益；

3. 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4. 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （六）基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的监察部，监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

### （3）相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

### （4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察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

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

### （2）风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

### （3）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

### （4）监察法律部

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

### （5）业务部门

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

## 3、风险管理和内部风险控制的措施

### （1）建立内控结构，完善内控制度

公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织 and 授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制

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

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

(5) 建立有效的内部监控系统

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

(6) 使用数量化的风险管理手段

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

(7) 提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史。其前身中国人民建设银行于 1954 年成立，于 1996 年易名为中国建设银行，是中国的四大国有商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。截至 2005 年 12 月 31 日止，中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)总资产达人民币 45,857.42 亿元，客户存款达人民币 40,060.46 亿元，2005 年实现税前利润人民币 553.64 亿元。截至 2005 年 12 月 31 日止，中国建设银行在中国内地设有 13,977 个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。英国《银行家》杂志 2005 年 7 月公布的世界 1,000 家大银行按一级资本排名中，中国建设银行列第 25 位，并被评选为中国“年度最佳银行”；荣获《财资》杂志 2005 年“中国最佳国内银行奖”；《全球托管人》杂志主办的“2005 年新兴市场托管服务调查”中，获得“中国最佳托管银行”称号。

中国建设银行总行设基金托管部，基金托管部下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处和监督稽核处 7 个职能处室，现有员工 70 余人。

## 2、主要人员情况

罗中涛，基金托管部总经理，曾就职于国家统计局、建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，基金托管部副总经理，曾就职于建设银行总行人力资源部、计划部、筹资部、国际业务部并担任领导工作，对计划、个人银行及国际业务具有丰富的经验。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2006 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰共 11 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华一道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、华安上证 180ETF、长城消费增值股票、上投摩根双息平衡混合、湘财荷银效率优选混合、交银施罗德稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华夏深圳中小企业板 ETF、华富货币市场等共 33 只开放式证券投资基金，托管基金财产规模达 881.77 亿份。

## (二) 基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国建设银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。基金托管部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## (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

### 1、监督方法

基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督基金管理人各基金的

投资运作，并主要采用技术系统监督和人工监督相结合的方式。

基金托管人利用自行开发的“证券投资基金托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合情况进行监督，并定期编写《基金投资运作监督报告》报送中国证监会。

基金托管人在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行人工检查监督。

## 2、监督流程

基金托管人每日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控；如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，严密监视，及时提醒基金管理人；发现违规行为，与基金管理人进行情况核实，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

基金托管人收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资用途及费用等内容进行合法合规性监督，无误后再进行划款并记入各基金会计账目。

每双月定期根据基金投资运作比例监督情况，分别编写《基金投资运作监督报告》，对各基金投资运作进行合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面的评价，报送中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

机构名称：博时基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人：吴雄伟

成立时间：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期间：持续经营

## 2. 代销机构

### (1) .中国建设银行股份有限公司

名称：中国建设银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）  
法定代表人：郭树清  
客户服务电话：95533  
网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (2) .交通银行股份有限公司

名称：交通银行股份有限公司  
注册地址：上海市仙霞路 18 号  
办公地址：上海市银城中路 188 号  
法定代表人：蒋超良  
电话：021-58781234  
传真：021-58408842  
联系人：曹榕  
客户服务电话：95559  
网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### (3) .深圳发展银行股份有限公司

名称：深圳发展银行股份有限公司  
注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦  
法定代表人：法兰克纽曼  
电话：0755-22168811  
传真：0755-82080714  
联系人：周勤  
客户服务电话：95501

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

(4) .中信银行

名称: 中信银行  
 注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座  
 法定代表人: 陈小宪  
 电话: 010-65544256  
 传真: 010-65541281  
 联系人: 朱庆玲  
 客户服务电话: 95558  
 网址: [www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

(5) .长江证券有限责任公司

名称: 长江证券有限责任公司  
 注册地址: 武汉市新华下路特 8 号  
 办公地址: 武汉市新华下路特 8 号  
 法定代表人: 胡运钊  
 联系人: 毕艇  
 电话: 027-65799560  
 传真: 027-85481532  
 客户服务电话: 4008888999  
 网址: [www.cz318.com.cn](http://www.cz318.com.cn)

(6) .东吴证券有限责任公司

名称: 东吴证券有限责任公司  
 注册地址: 江苏省苏州市石路爱河桥路 28 号  
 办公地址: 江苏省苏州市石路爱河桥路 28 号  
 法定代表人: 吴永敏  
 联系人: 方晓丹  
 电话: 0512-65581136  
 传真: 0512-65588021  
 客户服务电话: 0512-96288  
 网址: [www.dwjq.com.cn](http://www.dwjq.com.cn)

(7) .国泰君安证券股份有限公司

名称：                    国泰君安证券股份有限公司  
 注册地址：                上海市浦东新区商城路 618 号  
 法定代表人：              祝幼一  
 联系人：                  芮敏祺  
 电话：                    021-62580818—213  
 传真：                    021-52610172  
 客户服务电话：            400-8888-666  
 网址：                    www.gtja.com

(8) .广发证券股份有限公司

名称：                    广发证券股份有限公司  
 注册地址：                广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室  
 办公地址：                广东广州天河北路大都会广场 36、37、41 和 42 楼  
 法定代表人：              王志伟  
 联系人：                  肖中梅  
 电话：                    020-87555888  
 传真：                    020-87557985  
 客户服务电话：            020-87555888 转各营业网点  
 网址：                    www.gf.com.cn

(9) .光大证券有限责任公司

名称：                    光大证券股份有限公司  
 注册地址：                上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼  
 办公地址：                上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14 楼  
 法定代表人：              王明权  
 联系人：                  刘晨  
 联系电话：                021-68816000  
 传真：                    021-68815009  
 客户服务电话：            021-68823685  
 网址：                    www.ebscn.com

(10) . 国信证券有限责任公司

名称： 国信证券有限责任公司  
 注册地址： 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层  
 办公地址： 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层  
 法定代表人： 何如  
 联系人： 林建闽  
 电话： 0755-82130833 转 2181  
 传真： 0755-82133302  
 客户服务电话： 800-810-8868  
 网址： [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(11) . 海通证券股份有限公司

名称： 海通证券股份有限公司  
 办公地址： 上海市淮海中路 98 号  
 法定代表人： 王开国  
 联系人： 金芸  
 电话： 021-53858553  
 传真： 021-53858549  
 客户服务电话： 4008888001  
 网址： [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(12) . 华西证券有限责任公司

名称： 华西证券有限责任公司  
 注册地址： 四川省成都市陕西街 239 号  
 办公地址： 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）  
 法定代表人： 张慎修  
 电话： 0755-83025430  
 传真： 0755-83025991  
 联系人： 杨玲  
 客户服务电话： 4008-888-818  
 网址： [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(13) . 联合证券有限责任公司

名称： 联合证券有限责任公司

注册地址：                  深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层  
办公地址：                  深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层  
法定代表人：                王政  
联系人：                    范雪玲  
电话：                      0755-82492000  
传真：                      0755-82492187  
客户服务电话：              400-8888-555,0755-25125666  
网址：                      www.lhzq.com

(14) . 平安证券有限责任公司

名称：                      平安证券有限责任公司  
办公地址：                  深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼  
法定代表人：                叶黎成  
联系人：                    余江  
电话：                      0755-82450826  
传真：                      0755-82433794  
客户服务电话：              95511  
网址：                      www.pa18.com

(15) . 申银万国证券股份有限公司

名称：                      申银万国证券股份有限公司  
注册地址：                  上海市常熟路 171 号  
法定代表人：                谢平  
联系人：                    黄维琳、曹晔  
电话：                      021-54033888  
传真：                      021-54038844  
客户服务电话：              021-962505  
网址：                      www.sw2000.com.cn

(16) . 世纪证券有限责任公司

名称：                      世纪证券有限责任公司  
注册地址：                  深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层  
办公地址：                  深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层

法定代表人：段强  
电话：0755-83199599  
传真：0755-83199545  
联系人：夏尚  
客户服务电话：0755-83199511  
网址：www.csc.com.cn

(17) 兴业证券股份有限公司

名称：兴业证券股份有限公司  
注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦  
办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦  
法定代表人：兰荣  
联系人：杨盛芳  
电话：021-68419974  
传真：021-68419867  
客户服务电话：021-68419974  
网址：www.xyzq.com

(18) 湘财证券有限责任公司

名称：湘财证券有限责任公司  
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼  
办公地址：上海市浦东陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 楼  
法定代表人：陈学荣  
联系人：陈伟  
电话：021-68634518-8631  
传真：021-68865938  
客户服务电话：021-68865020  
网址：www.xcsc.com;www.eestart.com

(19) 中信建投证券有限责任公司

名称：中信建投证券有限责任公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
法定代表人：黎晓宏

电话：010-65183888  
传真：010-65182261  
联系人：权唐  
客户服务电话：400-8888-108（免长途费）  
网址：www.csc108.com

（20）. 中国银河证券有限责任公司

名称：中国银河证券有限责任公司  
注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  
法定代表人：朱利  
联系人：郭京华  
电话：010-66568587  
传真：010-66568536  
客户服务电话：010-68016655  
网址：www.chinastock.com.cn

（21）. 招商证券股份有限公司

名称：招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市益田路江苏大厦 40-45 层  
法定代表人：宫少林  
电话：0755-82943666  
传真：0755-82960141  
联系人：黄健  
客户服务电话：400-8888-111，0755-26951111  
网址：www.newone.com.cn

（二）注册登记机构

博时基金管理有限公司（内容同基金管理人）

（三）出具法律意见书的律师事务所

机构名称：国浩律师集团（北京）事务所

注册地址：北京市东城区建国门内大街贡院六号 E 座 9 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街贡院六号 E 座 9 层

电话：010-65171188

传真：010-65176800

联系人：黄伟民

经办律师：黄伟民、曾宪政

#### **（四）审计基金财产的会计师事务所**

机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址：上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

电话：021-61238888

传真：021-61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：汪棣、薛竞

## **六、基金的募集**

### **（一）基金募集的依据**

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2006 年 8 月 24 日证监基金字[2006]174 号文批准募集发售。

### **（二）基金类型**

混合型

### **（三）基金运作方式**

契约型开放式

### **（四）基金存续期间**

不定期

### **（五）基金份额的募集期限、方式和对象**

1. 募集期限：本基金于 2006 年 9 月 4 日—2006 年 9 月 22 日向社会公开发售。募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。具体时间由基金管理人与销售代理人约定（详见发

售公告及销售代理人相关公告)。

2. 销售渠道本公司的直销网点和销售代理机构的代销网点 (具体名单见发售公告)。

3. 销售对象: 依据中华人民共和国有关法律法规及其它有关规定可以投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者等。

#### (六) 基金份额的认购和认购金额的限制

1. 首次单笔最低购买金额不低于 500 元, 追加购买最低金额为 100 元, 详情请见当地销售机构公告。

2. 投资人认购前, 需按销售机构规定的方式全额缴款。

3. 设立募集期内, 投资人可多次认购本基金的基金份额, 已受理的认购申请不允许撤销。

基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 基金份额面值: 本基金份额面值为 1.00 元人民币

(2) 认购费率:

认购费率见下表:

前端认购费:

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万元	2%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.6%
500 万元 ≤ M < 1000 万元	1.2%
M ≥ 1000 万元	1000 元人民币

后端认购费:

持有基金时间 (Y)	后端认购费率
Y < 1	2.0%
1 ≤ Y < 2	1.6%
2 ≤ Y < 3	1.2%
3 ≤ Y < 5	0.6%
Y ≥ 5	0

### (3) 基金认购份额的计算

前端收费：计算公式如下：

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{认购利息}) / \text{认购价格}$$

$$\text{认购价格} = \text{基金份额面值} \times (1 + \text{认购费率})$$

例：某投资人投资 1 万元认购本基金，其认购资金的利息为 3 元，采用前端收费方式，其对应的认购费率为 2%，则其可得到的认购份额为：

$$\text{认购价格} = 1 \times (1 + 2\%) = 1.02 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (10000 + 3) / 1.02 = 9806.86 \text{ 份}$$

即：投资人投资 1 万元认购本基金，可得到 9806.86 份基金份额。

后端收费：计算公式如下：

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

例：某投资人投资 1 万元认购本基金，其认购资金的利息为 3 元，采用后端收费方式，则其可得到的认购份额为：

$$\text{认购份额} = (10000 + 3) / 1 = 10003 \text{ 份}$$

即：投资人投资 1 万元认购本基金，可得到 10003 份基金份额。

### (4) 份额余额的处理方式

认购金额的有效份额的计算保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

例：某投资人认购本基金 10000 元，采用前端收费模式，认购费率为 2%，假定认购期产生的利息为 3 元，则可认购基金份额为：

$$\text{认购价格} = 1 \times (1 + 2\%) = 1.02 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (10000 + 3) / 1.02 = 9806.86 \text{ 份}$$

即：投资人投资 1 万元认购本基金，可得到 9806.86 份基金份额。

### **（七）认购的程序**

1. 申请方式：书面申请或管理人及各销售人公布的其他方式。
2. 认购款项支付：基金投资人认购时，采用全额缴款方式。

### **（八）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 日到网点查询交易确认情况，在募集截止日后 4 个工作日内可以到网点打印交易确认书。

### **（九）认购期利息的处理方式**

募集期间募集的资金应存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

## **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，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，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。基金管理人在募集期间达到基金的备案条件，应当自基金募集结束之日起 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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

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。

基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以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**

基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合

同无法生效，则基金募集失败。

如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

如基金募集失败，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。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

申购与赎回应当在本基金的销售机构办理。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托或授权的销售代理人。基金管理人可根据实际情况变更或增减基金销售代理人，并予以公告。

投资人应该在销售机构指定的营业场所按照指定的方式和程序办理申购赎回等业务。销售机构也可以提供电话委托、传真交易或者网上交易等非现场方式，为投资人办理申购、赎回等业务。

### （二）申购和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 30 个工作日的时间开始办理，基金管理人应在申购赎回开放日 3 个工作日前在基金管理人网站及至少一种指定报刊上公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回时除外）。开放日的具体业务办理时间在相关披露文件中规定。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应对投资人利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在调整生效日的前 2 个工作日内在基金管理人网站及至少一种指定报刊上公告。

### （三）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. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回；
4. 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；

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依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### **（四）申购和赎回的数额限定**

1、首次单笔最低购买金额不低于 500 元，追加购买最低金额为 100 元，详情请见当地销售机构公告。

2. 每个交易账户最低持有基金份额余额为 100 份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，余额部分基金份额必须一同赎回；

3. 基金管理人可根据有关法律规定和市场情况，调整申购金额、赎回份额和账户最低持有余额的数量限制，基金管理人必须最迟在调整前 2 个工作日内在基金管理人网站及至少一种指定媒体上公告。

#### **（五）申购和赎回的程序**

##### **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，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回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，在 T+2 日后（包括该日）投资人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成交情况。

##### **3. 申购和赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### （六）申购和赎回的数额和价格

#### 1. 申购和赎回费率

前端申购费：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	2%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.6%
500 万元 ≤ M < 1000 万元	1.2%
M ≥ 1000 万元	1000 元人民币

后端申购费：

持有基金时间 (Y)	后端申购费率
Y < 1	2.0%
1 ≤ Y < 2	1.6%
2 ≤ Y < 3	1.2%
3 ≤ Y < 5	0.6%
Y ≥ 5	0

赎回费

持有基金时间 (Y)	赎回费率
Y < 1	0.8%
1 ≤ Y < 2	0.4%
2 ≤ Y < 3	0.2%
Y ≥ 3	0

2. 本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费主要用于本基金的市场推广和销售、注册登记等各项费用。

3. 本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，赎回费率最高不超过赎回金额的

1%，扣除注册登记费后的余额归基金财产，赎回费归基金财产的部分为赎回费的 25%。

4. 基金管理人可以根据情况调整申购费率，但最高不超过 3.0%。基金管理人可以在确保如前所述赎回费率最高不超过 1%的前提下，决定对不同持有期限的基金份额等实行差别化的赎回费率，并予公告，而无须召开基金份额持有人大会。赎回费率模式需公告并公平地对待同类投资人。基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

### （七）申购与赎回的计算方式

#### 1. 基金申购金额的计算

##### （1）前端收费模式下基金申购份额的计算

如果投资人选择缴纳前端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

基金份额申购价格 = 基金份额净值 × (1 + 申购费率)

申购份额 = 申购金额 / 基金份额申购价格

例：假定 T 日基金份额净值为 1.056 元，某投资人申购本基金 10000 元，采用前端收费方式，申购费率为 2%，则可申购基金份额为：

申购价格 =  $1.056 \times (1 + 2\%) = 1.07712$  元

申购份额 =  $10000 / 1.07712 = 9284.02$  份

即：投资人投资 1 万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为 1.056 元，可得到 9284.02 份基金份额。

##### （2）后端收费模式下基金申购份额的计算

如果投资人选择缴纳后端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

申购份额 = 申购金额 / 基金份额净值

例：假定 T 日基金份额净值为 1.056 元，某投资人申购本基金 10000 元，采用后端收费方式，则可申购基金份额为：

申购份额 =  $10000 / 1.056 = 9469.70$

即：投资人投资 1 万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为 1.056 元，可得到 9469.70 份基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

### (1) 前端收费模式下基金赎回金额的计算

赎回费用=基金份额净值×赎回费率×赎回份额

赎回金额=基金份额净值×赎回份额-赎回费用

例一：前端收费模式下基金赎回金额的计算举例

某投资人赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为一年两个月，对应的赎回费率为 0.4%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额计算过程为：

赎回费用=基金份额净值×赎回费率×赎回份额=1.016×0.4%×10000=40.64 元

赎回金额=基金份额净值×赎回份额-赎回费用=1.016×10000-40.64=10119.36 元

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，持有期所对应的赎回费率为 0.4%，则其可得到的赎回金额为 10119.36 元。

### (2) 后端收费模式下基金赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额×赎回日基金份额净值

后端申购费=赎回份额×申购日基金份额净值×适用的后端申购费率

赎回费=赎回总金额×适用的赎回费率

赎回金额=赎回总金额-后端申购费-赎回费

上述计算公式中，后端申购费的计算基数为本次要赎回的基金份额在当初购买时所需的申购金额，具体表达为：当初购买本次赎回份额的申购资金总额×该部分份额所对应的费率。

例二：后端收费模式下基金赎回金额的计算举例

假定某投资人申购本基金份额当日的基金份额净值为 1.056 元，该投资人选择后端收费模式，在二年零二个月后赎回 10,000 份，赎回当日的基金份额净值为 1.250 元，扣除的后端申购费用和获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10000×1.25=12500

后端申购费=10000×1.056×1.2%=126.72

赎回费=12500×0.2%=25

赎回金额=12500-126.72-25=12348.28

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.25 元，持有期所对应的赎回费率为 0.2%，后端申购费为 1.2%，则其可得到的赎回金额为 12348.28 元。

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

4. 申购份额余额的处理方式：申购的有效份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

5. 赎回金额的处理方式：赎回金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

6. 本基金份额净值的计算，保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

7. 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

#### **（八）拒绝或暂停申购的情形**

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
5. 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。
6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在中国证监会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。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个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. 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向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在中国证监会指定媒体上公告。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。

#### **（十）巨额赎回的情形及处理方式**

##### **1. 巨额赎回的认定**

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一日基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### **2. 巨额赎回的处理方式**

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

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

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为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日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资人未能赎回部分，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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，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. 巨额赎回的公告**

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 2 日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

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

#### **(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告。

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

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

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

#### **(十二) 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本基金与基金管理人管理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。

#### **(十三) 基金的非交易过户**

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。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

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；捐赠指受理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自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十四）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

在力争使基金份额净值高于价值增长线水平的前提下，本基金在多层次复合投资策略的投资结构基础上，采取低风险适度收益配比原则，以长期投资为主，保持基金资产良好的流动性，谋求基金资产的长期稳定增长。

### （二）投资理念

做投资价值发现者。

本基金认为，具有持续的现金收益和良好增长前景的上市公司，最终将得到投资人的认可并会在股价上得到体现。本基金力求在强化投资研究的基础上，长期坚持对股票进行质地分析和现金流分析，发现具有投资价值的上市公司。

同时，本基金致力于通过专业化投资方法将中国经济长期增长的潜力最大地转化为投资人的安全收益。

### （三）投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但本基金不会使用财务杠杆放大金融衍生产品的作用。

### （四）基金产品描述

本基金依托中国经济和资本市场的高速成长，充分发挥基金投资理财的规模经济效益，结合基金管理人的专业研究与管理能力，最大程度实现投资人财富的保值增值。

#### 1、核心概念—价值增长线

基金管理人通过自身的投资管理与风险管理，创造出一条随时间推移呈现非负增长态势的安全收益增长轨迹，简称价值增长线，并力争使基金份额净值高于价值增长线水平。

#### 2、价值增长线的确定

价值增长线固定周期（按日历计算的每 180 天）进行调整，每期期初按照上期基金份额

净值增长率的一定比率（提升率）和上期期末日的价值增长线水平来确定本期期末日的价值增长线水平，本期内任意一天的价值增长线水平由上期期末和本期期末的价值增长线水平线性插值计算得出。如果当期基金分红，则分红除权日之后（含分红除权日当日），价值增长线水平扣除分红额度向下调整。如果上期基金份额净值为零增长或负增长，则本期价值增长线保持上期期末水平。价值增长线从本基金开放日起计算，第一期价值增长线水平固定为 0.900 元。

价值增长线的计算公式如下所示。

t 期第 T 天的价值增长线数值：

$$G_t(T) = G_t(0) + \text{Max}\left(\frac{\text{NAV}_{t-1}(180)}{\text{NAV}_{t-1}(0)} - 1, 0\right) \times P \times G_t(0) \times \frac{T}{180} - \sum_{n=1}^m D_t^n(T')$$

如果  $T < T'$ ， $D_{tn}(T') = 0$ ；

如果  $T \geq T'$ ， $D_{tn}(T')$  等于 t 期第 n 次单位分红

t：价值增长线的调整期， $t=2, 3, \dots$ ；

T：t 期的第 T 天， $T=0, 1, 2, 3, \dots, 180$ ；

n：t 期第 n 次分红， $n=1, 2, \dots, m$ ；

$T'$ ：t 期第  $T'$  天（第 n 次）的分红除权日；

$G_t(T)$ ：t 期第 T 天的价值增长线数值；

$\text{NAV}_t(T)$ ：t 期第 T 天的复权基金份额净值，以第 T 天收盘价格计算；

$\text{NAV}_1(0) = 1$ ；

$G_1(T) = 0.9$ ；

$G_t(0) = G_{t-1}(180)$ ；

P：上一期基金份额净值增长率转化为投资人安全收益的提升率，该数值取常数 70%；

$D_{tn}(T')$ ：t 期第  $T'$  天（第 n 次）基金份额分红额度。

例如： $G_t(180) = G_{t+1}(0) = 0.90$  元， $\text{NAV}_t(0) = 1.00$  元， $\text{NAV}_t(180) = 1.05$  元， $P = 70\%$ ， $D_t(T') = 0$  元， $T = 85$ ，则第 t+1 期期末价值增长线数值为

$$0.90 + \left(\frac{1.05}{1.00} - 1\right) \times 70\% \times 0.90 = 0.932 \text{元}$$

，第 t+1 期第 85 天的价值增长线数值为

$$0.90 + \frac{0.932 - 0.90}{180} \times 85 = 0.915 \text{元}。$$

### 3、价值增长线的披露方式

本基金价值增长线将由本基金托管人核对无误后，由基金管理人连同本基金份额净值同时向公众披露。

## （五）投资决策

### 1、决策依据

（1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。依法决策是基金进行投资的前提。

（2）宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。这是基金投资决策的基础。

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是基金维护投资人利益的重要保障。

### 2、投资程序

（1）研究部、量化投资部和交易部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，并依据上述报告对本基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

（3）基金经理小组根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成本基金投资计划，包括资产配置、行业配置、股票/债券选择，以及买卖时机。

（4）交易部依据基金经理小组的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（5）风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理小组依据基金申购和赎回的情况

控制投资组合的流动性风险。

(6) 基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

### **3、投资策略**

本基金采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略。

#### **(1) 资产配置层面**

根据本基金的投资理念和风险管理方针，基金将通过战略资产配置和战术资产配置决策来确定投资组合中股票、债券和现金的比例。长期内，本基金将基于以宏观经济分析为重点的资产类别收益风险预测框架来调整资产配置。短期内，本基金将基于经济结构调整过程中政策、法规的相关变化，通过时机把握来调整资产配置。待股票指数期货推出后，本基金计划使用该衍生产品进行组合保险。

#### **(2) 股票组合层面**

本基金以全市场 A 股流通股加权指数作为市场基准指数，使用行业/风格结构来构建股票组合，并以单个行业/风格的市场基准指数权重作为考虑的出发点；为增强股票组合的预期收益，本基金将通过自上而下和自下而上相结合的分析方法来确定股票组合中单个行业或风格偏离其市场基准指数权重的比例；为控制股票组合与市场基准指数的跟踪误差，本基金将对单个行业或风格组合偏离其市场基准指数权重的程度进行限制。

#### **(3) 股票选择层面**

本基金将以 A 股市场具有良好流动性的上市股票作为选股范围，依据划分高质量、价值型和成长型的标准，通过估值比较、质量比较和增长比较三个层次的框架筛选出高质量的价值型公司和高质量的成长型公司，再基于竞争能力、估值比较和市场趋势等因素主动确定最终选择。

在债券投资方面，本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债（包括可转换债）等。本基金将在研判利率期限结构变化的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。在选择国债品种中，本基金重点分析国债品种所蕴涵的利率风险、流动性风险并且关注投资人结构，

根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债、企业债品种时，本基金重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质，资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。可转债的投资则结合债券和股票走势的判断，捕捉其套利机会。

本基金建仓时间为 3 个月，使股票仓位达到 30%，其中高质量的价值型公司和高质量的成长型公司股票的投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。

#### （六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为基金管理人定期事前公布的价值增长线。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可调整或变更业绩比较基准。

#### （七）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的中等风险品种，以在风险约束下期望收益最大化为核心，在收益结构上追求下跌风险有下界、上涨收益无上界的目标，其长期投资的单位风险下收益（夏普率）大于股票、小于国债。

#### （八）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开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金资产的非系统性风险，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）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；
- （2）投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%；
- （3）持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；
- （4）基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- （5）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

(6) 法律法规规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前述投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，本基金合同将从其规定；基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接进行变更，在变更前 2 个工作日内在基金管理人网站及指定报刊上发布公告，此项合同修改无须召开基金份额持有人大会。

## 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，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

## (九) 基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

## 十、基金的财产

### （一）基金资产的总值

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扣除基金负债后的价值。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应收利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 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；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的处分

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。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日。

### （三）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1. 股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

#### 2) 首次发行的股票，按成本价估值；

(3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零；

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

#### (5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值办法:

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值;

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值, 估值日没有交易的, 按最近交易日债券收盘净价估值;

(3) 未上市债券按其成本价估值;

(4) 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值;

(5) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第(1) — (4)小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第(1) — (4)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 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) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

3. 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。

4. 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, 按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (四) 估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (五) 估值程序

基金份额净值是按照每个开放日闭市后, 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。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每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。

#### （六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

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三位以内(含第三位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值出现错误时，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0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

(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，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(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。

本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、或销售机构、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”）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。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；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损失。

(7) 按法律法规规定的其他方式处理差错。

### 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资产净值计算错误偏差达到基金资产净值 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

#### **(七) 暂停估值的情形**

1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其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. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(八) 特殊情形的处理**

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(4)项或债券估值方法的第(5)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，本基金管理人和本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，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人和本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、基金收益与分配**

### **(一) 基金收益的构成**

基金收益包括：买卖证券差价、基金投资所得红利、股息、债券利息、银行存款利息、已实现的其他合法收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### **(二) 基金净收益**

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### **(三) 基金收益分配原则**

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；分红方式最终以注册登记机构确认的分红方式为准；

5、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

6、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

7、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的60%；但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **（四）收益分配方案**

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### **（五）收益分配方案的确定、公告与实施**

基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

#### **（六）基金收益分配中发生的费用**

现金红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

## **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、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金基金合同终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## （二）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：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%

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 3 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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

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 3 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、上述“（一）、基金费用的种类”中 3—8 项费用由基金托管人根据其他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，从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

## （四）基金管理费和托管费的调整

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或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，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 3 个工作日前在中国证监会指定的媒体上公告。

#### **（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。

## **十四、基金的会计与审计**

### **（一）基金会计政策**

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 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(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

## **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。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（以下简称“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。

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。

### （一）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、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，将基金招募说明书、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。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。

(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、基金份额发售公告

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。

## 3、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。

## 4、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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

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

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

## 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。

## 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报刊上。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报刊上。

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报刊和网站上。

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。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和本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本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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

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

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

#### 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 30 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，本基金管理人、本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。

##### (二) 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，对上述公开披露的相关基金信息中应由基金托管人复核的事项进行复核、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。

### （三）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资人在支付工本费后，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。

## 十六、风险揭示

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

### （一）市场风险

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

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

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

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

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

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

## (二) 管理风险

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

## (三) 流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。由于开放式基金在国内发展历史不长，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

## (四) 本基金特有风险

本基金与博时价值增长证券投资基金采用相同的投资目标、投资策略和投资理念，但在投资运作上完全独立。由于两只基金推出时的证券市场环境不同，建仓时机不同等因素，因此博时价值增长证券投资基金的过往业绩不预示本基金的未来表现。本基金与博时价值增长证券投资基金的未来业绩可能存在差异。

## (五) 其他风险

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

# 十七、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，基金合同经中国证监会核准后将终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 基金合并、撤销；

(5) 中国证监会允许的其他情况。

## **(二) 基金财产清算组**

基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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。

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。

## **(三) 清算程序**

- 1、基金合同终止后，发布基金清算公告；
- 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、聘请律师事务所出具法律意见书；
- 6、聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7、将基金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。

## **(四) 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。

**（五）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。

**（六）基金清算的公告**

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；基金财产清算结果由基金财产清算组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

**（七）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、基金合同内容摘要**

**（一）基金合同当事人的权利与义务**

**1、基金管理人的权利与义务**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

(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认购和申购费用、基金赎回手续费用和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；

(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；

- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (8) 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；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换销售代理机构，并依据销售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；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 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，确定基金份额申购、赎回价格；
- (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) 编制中期和年度基金报告；
- (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的决定；

(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、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利包括但不限于：

(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。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务包括但不限于：

- (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、中期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和基金份额申购、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的决定；

(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、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(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、基金托管人及基金管理人的代理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。

## （二）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 1、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）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。但根据法律法规的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）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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、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基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动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。

### 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，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。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,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3)代表基金份额 10%以上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,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4)代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集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。

#### 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

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 天在指定媒体公告。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。

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、书面表达意见的寄交和收取方式。

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。

#### 5、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和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,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。

3) 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。

4) 会议的召开方式由召集人确定,但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### (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,有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(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书代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

###### 2) 通讯开会方式

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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

④直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

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。

## 6、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以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 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日前 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

### 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、住所地址、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。

### 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 天公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(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。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效, 除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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3名基金份额持有人担任监票人。

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) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议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，会议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督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，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。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序；如基金管理人、基金托管人经通知仍拒绝派代表监督计票的，不影响大会会议决议的效力。

## 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议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效执行。

(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的决定。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。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。

### (三) 基金合同的变更与终止

#### 1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 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。但根据法律法规的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) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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，并报中国证监会备案：

- 1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；
- 2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；
- 3) 因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并于中国证监会出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 3 日内在至少一种指定媒体公告。

#### 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1) 基金份额持有人大会决定终止的；

2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4) 基金合并、撤销；

5) 中国证监会允许的其他情况。

#### **(四) 争议的解决**

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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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) 基金合同存放及投资人取得基金合同的方式**

本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资人在支付工本费后，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。

## **十九、托管协议的内容摘要**

### **(一) 托管协议当事人**

基金管理人名称：博时基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

邮政编码：518040

法定代表人：吴雄伟

成立时间：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]26 号

注册资本：壹亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金、基金管理

## 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。本基金的投资范围仅限于具有良好流动

性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但本基金不会使用财务杠杆放大金融衍生产品的作用。

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，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；

(2) 投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%；

(3) 持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；

(4) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

(5) 法律法规规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前述投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内调整完毕。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，本基金合同将从其规定；基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接进行变更，在变更前 2 个工作日内在基金管理人网站及指定报刊上发布公告，此项合同修改无须召开基金份额持有人大会。

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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，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、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送基金托管人。

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基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如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。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。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、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间交易市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定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。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应及时通知基金托管人并向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并承担交易对手不履行合同造成的损失，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，并不承担由此造成的任何损失和责任。

5、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。

6、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

7、基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

8、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、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，由此造成的损失由基金管理人承担。

9、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经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）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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。

2、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、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经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。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）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）对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，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任何责任。

(7) 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财产。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 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等事宜。

## 3、基金资金账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，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保管和使用。

(2) 基金资金账户的开立和使用，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) 基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

## 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或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。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、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，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由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

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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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。基金管理人应在重大合同签署后

及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在十个工作日内将正本送达基金托管人处。

重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

#### （五）基金资产估值、基金资产净值计算与复核

##### 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

###### （1）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金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

每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）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

（3）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。

##### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

###### （1）估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

###### （2）估值方法

###### a. 股票估值方法：

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 未上市股票的估值。

a) 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

b) 首次发行的股票，按成本价估值。

3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) —3) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) —3) 小项规定的方法对基金资产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, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

b. 债券估值办法:

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值。

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值, 估值日没有交易的, 按最近交易日债券收盘净价估值。

3) 未上市债券按其成本价估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值。

5) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) —4) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) —4) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 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) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

c. 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。

(3) 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 4) 项或债券估值方法的第 5) 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后三位以内(含第三位)发生差错时, 视为基金份额净值错误; 基金份额净值出现错误时, 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; 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、通报基

金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资人或基金支付赔偿金，就实际向投资人或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(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者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

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

(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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；

(4) 如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(5) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### 7、基金财务报表与报告的编制和复核

##### (1) 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### (2) 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### (3) 财务报表的编制与复核时间安排

###### 1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年报或者年度报告。

###### 2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

8、基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### **（六）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

本基金份额持有人名册由基金管理人提供资料，由基金托管人按规定建立并保管。在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。

#### **（七）争议处理和适用法律**

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本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）托管协议的修改与终止**

##### **1、托管协议的变更程序**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

##### **2、基金托管协议终止出现的情形**

- （1）本基金合同终止；
- （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。

## **二十、对基金份额持有人的服务**

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

#### （一）持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，投资人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；每季度结束后 10 个工作日内，基金管理人向所有持有本基金份额的投资人寄送对账单；每年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向所有持有本基金份额的投资人寄送对账单。

#### （二）红利再投资

本基金默认分红方式为现金分红，在权益登记日前，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，其所获红利将按权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

#### （三）定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。本基金的定期定额业务开通日期另行公告。

#### （四）基金转换

投资人可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。本基金的转换业务开通日期另行公告。

#### （五）网上交易

投资人可以通过中国银联电子支付服务有限公司、兴业银行卡、中国建设银行储蓄卡、招商银行一卡通或金葵花卡在本公司网站（<http://www.bosera.com>）办理基金网上交易业务。有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站查询。

#### （六）资讯服务

##### 1. 手机短信服务

投资人在申请开立本公司基金账户或变更帐户资料时如预留有效的手机号码，可获得手机短信公共信息服务、交易确认通知；或投资人可以发送短信到指定号码查询基金份额净值、基金账户份额等信息。

##### 2. 电子邮件服务

投资人在申请开立本公司基金账户或变更帐户资料时如预留有效的电子邮件，可获得邮

件公共信息服务，如《博时资讯》周刊、分红公告通知等信息。

投资人也可以自己在本公司网站订阅每日基金份额净值、各只基金的公开信息等内容

#### （七）客户服务中心

##### 1. 语音自助服务

客户服务中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话查询最新的基金份额净值、基金交易和持有信息等内容，与博时公司签订远程服务协议直销客户还可以通过电话进行基金的申购、赎回等交易。

##### 2. 人工坐席服务

客户服务中心提供每周 5 个工作日、每日不少于 8 小时的人工坐席服务。

客户服务电话：95105568（免长途话费） 010-65171155，按 9 转人工坐席。

传真：010-65187032

##### 3. 信邮服务

客户可以通过平信、电子邮件、网站留言三种方式和本公司联系，客户服务中心会有专人对客户的信邮进行回复。

#### （八）账户资料变更

为了便于客户及时得到博时提供的各项服务，请客户及时更新联系信息。客户可通过以下三种方式进行联系信息（包括地址、电话、EMAIL 等）的变更：

通过销售机构进行帐户资料变更业务申请；

通过本公司客户服务中心的人工坐席服务；

通过本公司网站网上交易与查询系统（网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)）自助修改联系信息。

#### （九）客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的网上留言、客户服务中心自动语音留言、客户服务中心人工坐席、平信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十一、其他事项

经中国证监会批准后，基金管理人将申请本基金在证券交易所上市交易，具体规定请参见基金管理人公告。

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人的办公场所，投资人可在办公时间查阅；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。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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

## 二十三、备查文件

以下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。

- (一) 中国证监会批准博时价值增长贰号证券投资基金募集的文件
- (二) 《博时价值增长贰号证券投资基金基金合同》
- (三) 《博时价值增长贰号证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请募集博时价值增长贰号证券投资基金之法律意见书

博时基金管理有限公司

2006年8月31日