

# 华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF) 基金合同

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 目录

一、前言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金的基本情况 .....	5
四、基金的历史沿革 .....	6
五、基金的存续 .....	7
六、基金份额的上市交易 .....	8
七、基金份额的申购、赎回与转换.....	9
八、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押等业务.....	14
九、基金合同当事人及其权利义务.....	15
十、基金份额持有人大会 .....	20
十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	25
十二、基金的托管 .....	26
十三、基金的销售 .....	26
十四、基金份额的登记结算.....	27
十五、基金的投资 .....	28
十六、基金的融资、融券 .....	33
十七、基金的财产 .....	33
十八、基金资产估值 .....	34
十九、基金费用与税收 .....	37
二十、基金收益与分配 .....	39
二十一、基金的会计与审计.....	40
二十二、基金的信息披露 .....	40
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	43
二十四、违约责任 .....	45
二十五、争议的处理 .....	46
二十六、基金合同的效力 .....	46

## 一、前言

(一)订立《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则

### 1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)的运作,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《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》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。

### 3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二)本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三)本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

## 二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：指华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)，本基金由兴安证券投资基金转型而成；
- 兴安基金：指兴安证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
- 基金合同或本基金合同：指《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充，本基金合同由《兴安证券投资基金基金合同》修订而成；
- 招募说明书：指《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其定期更新；
- 发售公告：指《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)集中申购期基金份额发售公告》；
- 托管协议：指《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)托管协议》及其任何有效修订和补充，本托管协议由《兴安证券投资基金托管协议》修订而成；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
- 《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的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及其不时做出的修订；
- 《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及其不时做出的修订；
- 《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订；
- 《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》及其不时做出的修订；
- 业务规则：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及代销机构业务规则等相关业务规则和实施细则；
- 元：指人民币元；

- 基金管理人：指华夏基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 登记结算业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 登记结算机构：指办理本基金登记结算业务的机构，本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、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》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人大会：指按照本基金合同第十部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 基金转型：指对包括兴安基金由封闭式基金转为上市开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)”等一系列事项的统称；
- 基金合同生效日：指本《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日，本基金合同自兴安证券投资基金终止上市之日起生效，原《兴安证券投资基金基金合同》自同一日起失效；
- 存续期：指自《兴安证券投资基金基金合同》生效之日起至本《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限；
- 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 集中申购期：指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过 1 个月；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；

- 赎回：**指在本基金合同生效后的存续期间，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本基金基金份额的行为；
- 基金转换：**指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金的基金份额的行为；
- 投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 基金销售：**指对基金申购、赎回、转换等业务(不包括交易)的统称；
- 场内销售：**指通过深圳证券交易所交易系统办理的基金销售业务；
- 场外销售：**指不通过深圳证券交易所交易系统，而通过各销售机构柜台系统办理的基金销售业务；
- 销售机构：**指基金管理人及本基金代销机构；
- 代销机构：**指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位；
- 基金销售网点：**指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
- 指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
- 深圳证券账户：**指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户(简称“A股账户”)或证券投资基金账户(简称“基金账户”)，投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、申购、赎回等业务时需持有深圳证券账户；
- 开放式基金账户：**指投资者以深圳证券账户为基础、在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，投资者办理场外申购、赎回等业务时需具有开放式基金账户；
- 交易账户：**指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
- 证券登记系统：**指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
- 基金登记系统：**指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，又简称为TA系统；
- 系统内转托管：**指投资者将托管在某场内代销机构(或营业网点)的基金份额转托管到其他场内代销机构(或其他营业网点)，或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到其他场外代销机构或基金管

	理人的行为；
跨系统转托管：	指投资者将托管在某场内代销机构的基金份额转托管到基金管理人或某场外代销机构，或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到某场内代销机构的行为；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后(不包括 T 日)第 n 个工作日，n 指自然数；
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、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：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金的基本情况

#### (一)基金名称

华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)

#### (二)基金的类别

股票型

#### (三)基金的运作方式

契约型、开放式

(四)基金投资目标

把握经济发展趋势和市场运行特征,以行业投资价值评估为导向,充分利用行业周期轮动现象,挖掘在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会,并精选优势行业内的优质个股进行投资,实现基金资产的持续增值。

(五)基金份额初始面值

本基金的初始面值为人民币1.00元

(六)基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

(七)基金存续期限

不定期

#### 四、基金的历史沿革

华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)由兴安证券投资基金转型而成。

(一)兴安证券投资基金

兴安证券投资基金是按《证券投资基金管理暂行办法》、国务院关于原有投资基金清理规范的相关规定和中国证监会《关于黑龙江省原有投资基金清理规范实施方案的批复》(证监基金字[2000]27号)、《关于同意龙江基金、广源基金、龙银基金合并规范为兴安证券投资基金并上市的批复》(证监基金字[2000]62号)、《关于同意龙江基金、广源基金、龙银基金合并规范为兴安证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2000]63号),由龙江基金、广源基金、龙银基金等三只基金经清理规范后合并而成的契约型封闭式证券投资基金。

兴安证券投资基金的发起人及基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国银行(于2004年8月26日改制为中国银行股份有限公司)。基金管理人和基金托管人已于2000年7月20日正式接管本基金,基金规模为236,712,708份基金份额,基金存续期为10年(1992年12月29日至2002年12月29日)。

根据中国证监会证监基金字[2000]63号文《关于同意龙江基金、广源基金、龙银基金合并规范为兴安证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》,经深圳证券交易所深证上[2000]129号文批准,兴安证券投资基金于2000年9月20日在深圳证券交易所挂牌交易。兴安证券投资基金于2000年11月20日将基金份额总份额扩募至5亿份基金份额,存续期限延长5年至2007年12月29日。

2007年10月25日,兴安证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开,大会讨论通过了兴安基金转型议案,内容包括兴安基金由封闭式基金转为上市开放式基金,调整存续期限,终止上市,调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会2007年11月13日证监基金字[2007]314号文核准,持有人大会决议生效。依据持有人大会决议,基金管理人将向深圳证券交易所申请基金终止上市,自基金终止上市之日起,原《兴安证券投资基金基金合同》失效,《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,基金正式转型为上市开放式基金,存续期限调整为不定期,基金投资目标、范围和策略调整,同时基金更名为“华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)”。

## (二)龙江基金、龙银基金、广源基金三只基金

龙江基金原名龙江投资基金,是经中国人民银行黑龙江省分行1992年12月29日(银黑金管字[1992]第836号)《中国人民银行黑龙江分行关于设立龙江投资基金的批复》文件批准设立的。黑龙江省证券公司、中国光大银行黑龙江分行、中国农业银行黑龙江省信托投资公司是该基金的发起人,黑龙江省证券公司基金管理部是该基金的管理人。1992年发行面值为人民币1元,规模为8000万基金单位。历年皆以现金形式分红。

龙银基金原名龙银投资基金,是经中国人民银行黑龙江省分行1992年12月(银黑金管字[1992]第834号)《中国人民银行黑龙江分行关于设立龙银投资基金的批复》文件批准设立的。中国银行黑龙江国际信托投资公司为该基金发起人、管理人。1992年发行面值为人民币1元,规模为6000万基金单位。历年皆以现金形式分红。

广源基金原名广源投资基金,是经中国人民银行黑龙江省分行1992年12月(银黑金管字[1992]第837号)《中国人民银行黑龙江分行关于设立广源投资基金的批复》文件批准设立的。哈尔滨国际信托投资公司是该基金的发起人和管理人。1992年发行面值为人民币1元,规模为7000万基金单位。历年皆以现金形式分红。

根据原有投资基金清理规范的有关要求及《关于黑龙江省原有投资基金清理规范补充方案的批复》(证监基金字[2000]27号)文的精神,将以上三只基金规范重组为兴安证券投资基金。

## 五、基金的存续

### (一)基金份额的变更登记

自兴安基金终止上市之日起2个工作日内,基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司取得终止上

市权益登记日的基金份额持有人名册之后，将进行基金份额更名以及必要的信息变更，中国证券登记结算有限责任公司将根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

## (二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，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和报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 六、基金份额的上市交易

### (一)基金在深圳证券交易所的上市

本基金集中申购期结束后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市：

- 1、基金资产净值不低于2亿元；
- 2、基金份额持有人不少于1000人；
- 3、深圳证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告。

### (二)基金在深圳证券交易所的交易

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》等有关规定。

### (三)基金在深圳证券交易所暂停上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易：

- 1、基金不再具备本条第(一)款规定的上市条件；
- 2、基金违反法律法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、基金严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停基金上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所暂停基金上市的决定之日起2个工作日内在至少一种指定媒体发布基金暂停上市公告。

当暂停上市情形消除后，基金管理人应向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在至少一种指定媒体发布基金恢复上市公告。

#### (四)基金在深圳证券交易所终止上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易：

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

发生上述终止上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内在至少一种指定媒体发布基金终止上市公告。

## 七、基金份额的申购、赎回与转换

### (一)申购与赎回的场所

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

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

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

### (二)基金销售对象

个人投资者、机构投资者(有关法律法規规定禁止购买者除外)和合格境外机构投资者，以及法律法規或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### (三)申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对

前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

## 2、申购与赎回的开始时间

本基金自基金合同生效后，将开始办理集中申购，暂不开放赎回，集中申购期不超过1个月。集中申购期结束后，本基金可暂停办理申购和赎回。暂停期间结束后，本基金将开放申购、赎回。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前1个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (四)申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日予以公告。

## (五)申购与赎回的程序

### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

### 2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求登记结算机构在T+1日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或登记结算机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

### 3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后，基金管理人应指示基金托管人按规定将基金赎回款从基金资产中划出，经销售机构划往投资者银行账户，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

#### (六)申购与赎回的数额限制

- 1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。
- 2、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

#### (七)申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除前端申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，场内申购份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。场外申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用、后端申购费用(如有)的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### (八)申购和赎回的费用及其用途

- 1、本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，赎回费率最高不超过赎回金额的5%。
- 2、本基金申购费可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取。在申购时收取的申购费称为前端申购费，在赎回时收取的申购费称为后端申购费。实际执行的申购费率和计算方式在招募说明书中载明。
- 3、本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取。实际执行的赎回费率和计算方式在招募说明书中载明。
- 4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用

于支付登记结算费等相关手续费。

5、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或计算方式。费率或计算方式如发生变更，基金管理人应在调整实施2个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

6、基金管理人可以在不违反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，经相关销售机构同意，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

#### (九)申购与赎回的登记结算

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

2、投资者T日申购基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记结算手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者T日赎回基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的登记结算手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日予以公告。

#### (十)巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额)与净转出申请(转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额)之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回或部分延期赎回。

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

(2)部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，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，应当按单个基

金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，赎回价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部赎回为止。

(3)当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

(4)暂停接受和延缓支付：本基金连续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，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体公告。

#### (十一)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1)因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- (2)证券交易场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)基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- (5)因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- (6)个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；
- (7)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的；
- (8)深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购业务的；
- (9)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1)因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- (2)证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3)基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5)深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回业务的；

(6)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1)如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2)如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3)如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。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，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一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，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

## 八、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押等业务

登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻、质押等

业务，并收取一定的手续费用。

## 九、基金合同当事人及其权利义务

### (一)基金管理人

#### 1、基金管理人基本情况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

成立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1998]16 号文

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会等有权机关批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.38 亿元人民币

存续期间：100 年

#### 2、基金管理人的权利

(1)依法募集基金，办理基金备案手续；

(2)依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

(3)在符合法律法规规定的前提下，制订、修改并公布有关基金申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4)在符合法律法规和基金合同的规定的规定的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取申购费、赎回费及其他经事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5)根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6)在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认

为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8)选择、更换基金登记结算机构，获取基金份额持有人名册；

(9)在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10)在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11)依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

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

(13)在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14)依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

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

(16)法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

(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)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；

(3)办理基金备案手续；

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

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

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

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

(8)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9)依法接受基金托管人的监督；

(10)编制季度、半年度和年度基金报告；

(11)采取适当合理的措施使计算开放式基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(12)计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(15)按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(17)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；

(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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(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)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

## (二)基金托管人

### 1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金

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

## 2、基金托管人的权利

- (1)依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2)依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3)监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4)在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5)依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6)法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 3、基金托管人的义务

- (1)安全保管基金财产；
- (2)设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金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)对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (7)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8)按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9)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以保密，不得向他人泄露；
- (10)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11)对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行

为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (12)建立并保存基金份额持有人名册；
- (13)复核、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；
- (14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17)按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18)因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19)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；
- (20)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### (三)基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (1)分享基金财产收益；
- (2)参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4)按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7)监督基金管理人的投资运作；
- (8)对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9)法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1)遵守法律法规、基金合同、业务规则及其他有关规定；
- (2)遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构关于开放式基金业务的相关规则及规定。
- (3)缴纳基金申购款项及基金合同规定的费用；

- (4)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；
- (5)不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (6)执行基金份额持有人大会的决议；
- (7)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、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (8)法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 十、基金份额持有人大会

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

(二)有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 9、基金合同、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三)有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- 4、经中国证监会允许，基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 5、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 6、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

- 7、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；
- 8、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四)召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

3、代表基金份额10%以上(除特别说明，以上含本数，下同)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书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

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

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

(五)通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、确定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；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，如召集人为基金管理人，还应另行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。

#### (六)开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，连续公布相关提示性公告；

2、召集人在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；

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

4、本人直接出具有效书面意见或授权他人代表出具有效书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

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

6、会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有

效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具有效书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (七)议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

(2)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

(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。

##### 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日，在公证机关及监督人的监督下，由召集人统计全部有效表决并形成决议；如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。决议报经中国证监会核准或备案后生效。

#### (八)表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### (1)特别决议

特别决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过。

##### (2)一般决议

一般决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上多数(不含50%)通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效，其他事项均以一般决议的方式通过即为有效。

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。

#### (九)计票

##### 1、现场开会

(1)基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代

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(如果基金管理人为召集人,则监督员由基金托管人担任;如基金托管人为召集人,则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人,但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3)如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 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监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监督员进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

## (十)生效与公告

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

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

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内,由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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

(十一)法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

## 十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一)基金管理人、基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

- (1)基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2)基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3)基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

- (1)基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2)基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3)基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

### (二)基金管理人、基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

- (1)提名：新任基金管理人由基金托管人或代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。
- (2)决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。
- (3)核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后2日内在至少一种指定媒体上公告。

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

(5)审计并公告：原基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6)基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

#### 2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金托管人。在新基金托管人

产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1)提名：新任基金托管人由基金管理人或代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

(2)决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。

(3)核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后2日内在至少一种指定媒体上公告。

(4)交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5)审计并公告：原基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

### 3、基金管理人与基金托管人同时更换

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

(2)基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行。

(3)公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在至少一种指定媒体上联合公告。

4、新基金管理人接受基金管理或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

## 十二、基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十三、基金的销售

(一)本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的申购、赎回、转换、非交易过户、

转托管、定期定额投资和客户服务等业务。

(二)本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金申购、赎回业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

#### 十四、基金份额的登记结算

(一)本基金基金份额的登记结算业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二)本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金的登记结算业务根据《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》等相关业务规则办理。

本基金份额采用分系统登记原则。投资者通过证券经营机构在深圳证券交易所申购或交易买入的基金份额，登记在证券登记系统，以投资者证券账户记载；投资者通过基金管理人及场外代销机构申购的基金份额，登记在基金登记系统，以投资者开放式基金账户记载。

基金管理人应与登记结算机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和登记结算机构在登记结算业务中的权利和义务，保护投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三)登记结算机构履行如下职责：

- 1、建立和保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 2、配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的登记结算业务；
- 4、接受基金管理人的监督；
- 5、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录15年以上；
- 6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；
- 7、按本基金合同及招募说明书、定期更新的招募说明书的规定，为投资者办理非交易过户、转托管等业务、提供基金收益分配等其他必要的服务；
- 8、在法律、法规允许的范围内，对登记结算业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3

个工作日在至少一种指定媒体上公告；

9、法律法规规定的其他职责。

(四)登记结算机构履行上述职责后，有权取得登记结算费。

## 十五、基金的投资

### (一)投资目标

把握经济发展趋势和市场运行特征，以行业投资价值评估为导向，充分利用行业周期轮动现象，挖掘在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会，并精选优势行业内的优质个股进行投资，实现基金资产的持续增值。

### (二)投资范围

限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60% ~ 95%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0 ~ 3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0 ~ 40%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0 ~ 20%；现金以及到期日在 1 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。

### (三)投资理念

国际经验表明，受经济周期影响，产业发展存在周期轮动现象。一般来说，在经济周期的不同阶段，不同行业受影响的程度往往存在差异，某些特定行业能够在经济周期的特定阶段获得更好地表现，从而形成阶段性的优势行业。因此，借鉴国际产业周期轮动规律，并结合对我国经济周期不同阶段产业发展特征的考察，有助于把握我国经济周期的阶段特征及其对应的优势行业，从而实现行业景气度和行业成长前景的前瞻性认识和挖掘，充分分享行业景气度提高和业绩成长所带来的价值增值收益。

### (四)投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金的资产配置采用"自上而下"的多因素分析决策支持系统，综合定性分析和定量分析手

段，结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

## 2、股票投资策略

本基金遵循行业间优化配置和行业个股精选相结合的股票投资策略，其中行业间优化配置以宏观经济周期分析为基础，重点关注特定经济周期阶段下的优势行业；行业内个股精选着重考察个股的行业发展获益程度，重点关注行业内的优势个股。本基金将对行业和个股投资价值进行持续评估，以准确把握优势行业及优势个股的变化趋势，并据此对组合的行业和个股配置进行及时调整。

### (1)行业配置

本基金的行业配置从定性分析和定量分析两个角度进行考察，依据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行重点配置。

- 定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。本基金重点关注行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。
- 定量分析方面，主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选，上述三项指标的数值均大于 1 的行业将是本基金的投资重点。

### (2)个股选择

本基金重点关注优势行业中获益程度最高的优势个股。优势个股的评价标准包括：

- 公司主营业务鲜明，行业地位突出，具体的考察指标包括公司的主营业务收入不低于行业平均、主营业务收入占公司总收入的比例高于 50%等；
- 公司财务状况良好，盈利能力较强且资产质量较好，具体的考察指标包括成长性指标(过去三年的平均主营业务收入增长率、过去三年的平均息税折旧前利润增长率)不低于行业平均、盈利指标(过去三年的平均净资产收益率、过去三年的平均投资回报率)不低于行业平均
- 公司治理结构规范，管理水平较高，拥有市场自主品牌并具有较强的自主创新和市场拓展能力

- 公司的预期股息回报率高于行业平均和预期动态市盈率低于行业平均

### 3、债券投资策略

本基金将采取多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

#### (1)久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

#### (2)收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。如预测收益率曲线平行移动或变平时，将采取哑铃型策略；预测收益率曲线变陡时，将采取子弹型策略。

#### (3)债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资，主要通过信用风险的分析和管理，获取超额收益。

### 4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

此外，本基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

#### (五)投资管理体制

公司实行投资决策委员会领导下的投资总监负责制。投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；投资总监全面负责公司的投资、研究、交易工作，向投资决策委员会报告；基金经理负责所管理基金的日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

#### (六)投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。

严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

#### 1、研究

本基金股票投资研究依托公司整体的研究平台，同时整合了外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果。公司研究员按行业分工，负责对各行业以及行业内个股进行跟踪研究。在财务指标分析、实地调研和价值评估的基础上，研究员对所研究的股票、行业提交投资建议报告，供基金经理和投资决策委员会参考。此外，公司有专门的宏观经济研究员，负责分析消费、投资、进出口、就业、利率、汇率以及政府政策等因素，为资产配置决策提供支持。公司还设有固定收益部，专门负责债券投资研究。

#### 2、资产配置决策

投资决策委员会负责判断一段时间内证券市场的基本走势，决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内，决定基金的具体资产配置。

#### 3、组合构建

基金经理根据研究员提交的投资报告，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。对于拟投资的个股，基金经理将采取长期关注、择机介入的方法，以降低买入成本、控制投资风险。对于买入的股票，基金的持有周期一般较长，长期持有的操作策略可有效降低基金的交易费用和变现成本，从而提高基金的收益水平。

#### 4、交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

#### 5、风险与绩效评估

风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

#### 6、组合监控与调整

基金经理将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

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，并在基金招募说明书及其更新中公告。

### (七)业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。

整体业绩比较基准构成为：

基准收益率=沪深 300 指数收益率 × 80% + 上证国债指数收益率 × 20%

未来，如基金变更投资比例范围，或市场中出现代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，基金管理人可在履行适当程序后，变更本基金的基准指数或权重构成。

### (八)风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于高风险、高收益的品种。

### (九)投资禁止行为与限制

#### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5)向其基金管理人、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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

#### 2、基金投资组合比例限制

- (1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- (2)本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；
- (3)基金财产参与股票发行申购时，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (4)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (5)本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的3%；

- (6)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- (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)本基金与本基金管理人管理的其他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%；
- (11)法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### (十)投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从10个交易日延长到3个月。

## 十六、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十七、基金的财产

### (一)基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### (二)基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三)基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### (四)基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、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范围。
- 4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十八、基金资产估值

### (一)估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回、转换等提供计价依据。

### (二)估值日

本基金合同生效后，每个开放日对基金财产进行估值。

### (三)估值对象

基金所持有的股票、债券和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### (四)估值方法

#### 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：

首次发行未上市的股票，按成本或估值技术确定公允价值；

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同

一股票的市价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (2)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，如果基金管理人充分的理由认为按本项第(1) - (2)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；

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

(1)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，以最近交易日计算的净价估值；

(3)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用成本或估值技术确定公允价值；

(4)发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(5)在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；

(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(7)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (6)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，如果基金管理人充分的理由认为按本项第(1) - (6)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；

(8)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

(1)基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)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，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)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；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

#### (五)估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按本基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六)暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、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，已决定延迟估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

#### (七)基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算

结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

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

#### (八)估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位(含第3位)内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### (九)特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，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。

## 十九、基金费用与税收

### (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、基金上市初费及年费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金的资金汇划费用；

9、基金收益分配中发生的费用；

10、按照国家有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

## (二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第(一)款第3至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

## (三)不列入基金费用的项目

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

## (四)基金管理费和基金托管费的调整

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

## (五)税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 二十、基金收益与分配

### (一)收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3、基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

4、其他收益。

### (二)收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

4、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的20%，基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

6、基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按分红权益再投资日的基金份额净值转成相应的基金份额(具体以届时的基金分红公告为准)；如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式。

7、法律法规或监管机构另有规定的，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、分配方式及有关手续费等内容。

### (四)收益分配方案的确定与公告

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

### (五)收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，登记结算机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值转为基金份额(具体以届时的基金分红公告为准)。

## 二十一、基金的会计与审计

### (一)基金会计政策

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

### (二)基金审计

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

## 二十二、基金的信息披露

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至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者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。

### (一)基金合同、基金托管协议、基金招募说明书

本基金合同、托管协议经中国证监会核准之后，基金管理人应当将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金管理人应当在集中申购期开始3日前，将招募说明书登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的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。

#### (二)集中申购期基金份额发售公告

基金管理人应当就集中申购期基金份额发售的具体事宜编制集中申购期基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### (三)基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少1个工作日在指定报刊及网站上公告。

#### (四)基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少3个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### (五)基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在集中申购期开始之前，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。

自集中申购期开始之日起，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### (六)定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

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

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

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

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。  
法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

(七)临时报告与公告

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

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事件，包括：

- 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、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金登记结算机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 27、基金份额折算与变更登记；
- 28、基金推出新业务或服务；
- 29、基金份额持有人大会的决议；
- 30、中国证监会规定的其他事项。

#### (八)公开澄清

在基金合同期限内，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和深圳证券交易所。

#### (九)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、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

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，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十三、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、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同第十条第(二)款约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如变更基金合同的事项属于本基金合同第十条第(三)款约定的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (二)基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、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、基金托管人承接的；
- 4、法律法规规定和经中国证监会认定的其他情形。

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

### (三)基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

(1)自基金合同终止事由发生之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 3、清算程序

- (1)基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2)基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4)对基金财产进行评估和变现；
- (5)制作清算报告；
- (6)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；
- (7)将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8)对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

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)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十四、违约责任

(一)本基金合同当事人不履行本基金合同或履行本基金合同不符合约定的，应当承担违约责任。

(二)因基金管理人或基金托管人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别承担相应的责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

(三)一方当事人违反本基金合同，给其他基金合同当事人或基金财产造成损失的，应承担相应的赔偿责任。

(四)发生下列情况时，当事人可以免责：

1、基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章作为或不作为而造成的损失等；

2、基金管理人在没有欺诈或过失的情况下，由于按照本基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

3、不可抗力：基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本基金合同的，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任，但法律法规另有规定的除外。任何一方迟延履行基金合同后发生不可抗力的，不能免除责任。

(五)在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。

(六)本基金合同当事人一方违约后，其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

## 二十五、争议的处理

(一)本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

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

## 二十六、基金合同的效力

(一)本基金合同由《兴安证券投资基金基金合同》修订而成。本基金合同经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权签字人签字，报中国证监会核准后，自兴安基金终止上市之日起生效，原《兴安证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

(二)本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三)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。

(四)本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。

(五)本基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所。投资者可登陆基金管理人和基金托管人网站查询。

(以下无正文)



(本页为签署页，无正文)

基金管理人：华夏基金管理有限公司(盖章)

法定代表人或授权签字人：

签订地：北京市

签订日： 年 月 日

基金托管人：中国银行股份有限公司(盖章)

法定代表人或授权签字人：

签订地：北京市

签订日： 年 月 日