



嘉实优质企业股票型证券投资基金 基金合同

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人： 上海浦东发展银行股份有限公司



目 录

一、前 言	3
二、释 义	4
三、基金的基本情况	7
四、基金的历史沿革	8
五、《基金合同》当事人	9
六、基金管理人的权利与义务	11
七、基金托管人的权利与义务	14
八、基金份额持有人的权利与义务	17
九、基金份额持有人大会	18
十、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序	23
十一、基金份额的集中发售	25
十二、基金的存续	26
十三、基金份额的申购与赎回	27
十四、基金的非交易过户与转托管	32
十五、基金托管	33
十六、基金销售业务	34
十七、基金登记业务	35
十八、基金的投资	36
十九、基金的融资、融券	42
二十、基金资产	43
二十一、基金资产估值	44
二十二、基金费用与税收	50
二十三、基金收益与分配	52
二十四、基金的会计与审计	54
二十五、基金的信息披露	55
二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	57
二十七、业务规则	59
二十八、违约责任	60
二十九、争议处理	61
三十、《基金合同》的效力	62
三十一、基金管理人、基金托管人签章	63

一、前 言

为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《基金法》及其他有关法律法规的规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《嘉实优质企业股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）。

《基金合同》是规定合同当事人之间基本权利义务的法律文件。《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。其中，基金管理人、基金托管人自《基金合同》签订并生效之日起即成为《基金合同》的当事人；基金投资者自合法取得基金份额时即成为《基金合同》的当事人——基金份额持有人。《基金合同》的当事人应按照《基金法》及其他有关法律法规的规定享有权利、承担义务。

嘉实优质企业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由基金管理人按照《基金法》及其他有关法律法规的规定募集、发售和管理，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）审查批准。

中国证监会对本基金募集、发售和管理的审查批准，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。

基金管理人保证依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但由于证券投资具有一定的风险，因此基金管理人并不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

《基金合同》应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致《基金合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。

二、释 义

《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：	指嘉实优质企业股票型证券投资基金；
《基金合同》：	指《嘉实优质企业股票型证券投资基金基金合同》；
《招募说明书》：	指《嘉实优质企业股票型证券投资基金招募说明书》；
《托管协议》：	指《嘉实优质企业股票型证券投资基金托管协议》；
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《中华人民共和国证券投资基金法》；
法律法规：	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件；
《基金合同》当事人：	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指嘉实基金管理有限公司；
基金托管人：	指上海浦东发展银行股份有限公司；
基金份额持有人	指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
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的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	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开放式证券投资基金的其他投资者的总称
注册登记业务：	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、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；



注册登记机构:	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构;
基金代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构:	指基金管理人及基金代销机构;
投资转型	指根据《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会会议通知》所附议案及嘉实浦安混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决程序和表决结果,嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金保本到期日后的投资转型变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”,变更的内容包括但不限于基金名称、基金投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、业绩比较基准、分红条款等事项。
《基金合同》生效日:	指《嘉实优质企业股票型证券投资基金基金合同》生效起始日,原《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》自同一日起失效。
集中发售期	指本基金合同生效前,销售机构向投资者发售本基金的一段时间
申购:	指在本《基金合同》生效后,投资者申请购买本基金份额的行为;
赎回:	指基金份额持有人按《基金合同》规定的条件,要求基金管理人购回本基金份额的行为;
基金账户:	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户;
存续期:	指基金存续的不定期期限;
开放日:	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日;
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;
T 日:	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期;
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
元:	指人民币元;

基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
基金净收益	指基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额；
基金资产总值：	指基金购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值；
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；
每一基金份额资产净值：	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数后的价值；
持有期：	自投资者获得该基金份额之日起不间断持有的期间；
更新招募说明书：	《基金合同》生效后，在每六个月结束之日起 45 日内，对招募说明书进行更新，并在公告时间 15 日前报中国证监会审核。更新招募说明书将登载在公司网站上，更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。更新招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后一日；
不可抗力：	是指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。包括但不限于国家《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、地震、台风、水灾、流行病等自然灾害，以及罢工、国家紧急状况、政治动乱、戒严、战争、恐怖主义行为等事件。



三、基金的基本情况

(一) 基金的名称:

嘉实优质企业股票型证券投资基金

(二) 基金的类别:

股票型基金

(三) 基金的运作方式

契约型开放式

(四) 基金的投资目标

力争为基金份额持有人创造长期超额收益。

(五) 基金份额面值:

每一基金份额初始面值为人民币 1.00 元

(六) 基金存续期限:

不定期

四、基金的历史沿革

根据《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》及《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，嘉实优质企业股票型证券投资基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金保本到期日后投资转型而成。

嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金经中国证监会证监基金字[2004]151 号文批准，自 2004 年 10 月 18 日起向全社会公开募集，募集有效认购总户数为 11,607 户，募集资金及其产生的利息共计 1,296,361,260.94 元，折合基金份额 1,296,361,260.94 份。嘉实基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2004 年 12 月 1 日获书面确认，嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同自该日起正式生效。

2007 年 10 月 31 日，嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金保本到期日后的投资转型变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”，修改的内容包括但不限于基金名称、投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、业绩比较基准、分红条款等事项。依据中国证监会 2007 年 11 月 22 日证监基金字[2007]320 号文核准，嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金持有人大会决议生效。依据该持有人大会决议，原《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》自该合同规定的股票基金期开始之日起失效，本《基金合同》自原《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》规定的股票基金期开始之日起生效，同时基金更名为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。



五、《基金合同》当事人

（一）基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人：王忠民

总经理：赵学军

成立日期：1999 年 3 月 25 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[1999]5 号

经营范围：基金管理业务、发起设立基金、中国证监会批准的其他业务

组织形式：中外合资经营企业

注册资本：1 亿元

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

经营范围：吸收公众存款；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；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；提供保管箱服务；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；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；代理销售开放式证券投资基金；证券投资基金托管、保险资产托管、全国社会保障基金托管及经中国人民银行批准的其他业务。



组织形式：股份有限公司

注册资本：43.5488 亿元人民币

存续期间：持续经营

（三）基金份额持有人

基金投资者购买本基金份额即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》发售的基金份额，即成为《基金合同》的当事人——基金份额持有人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在《基金合同》上的书面签署为必要条件。

六、基金管理人的权利与义务

（一）基金管理人的权利

- 1、依法申请并募集基金；
- 2、自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的约定运用并管理基金财产并独立决定其投资方向和投资策略；
- 3、获取基金管理费以及《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》约定的其他收入；
- 4、办理或委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额发售、申购和登记事宜，并获取认购（申购）费；
- 5、作为本基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并；自行承担基金注册登记机构、办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》约定的费用，或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册与过户登记业务，并按照《基金合同》对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 6、监督基金托管人的托管行为，如认为基金托管人违反《基金合同》或《基金法》及其他有关法律法规的规定，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7、选择和更换基金代销机构，并对其销售代理行为进行必要的监督；
- 8、按照《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的约定确定基金收益分配方案；
- 9、《基金合同》约定的情形出现时，决定拒绝或暂停受理基金份额的申购、暂停受理基金份额的赎回；
- 10、按照规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 11、依照《基金法》及其他有关法律法规，代表基金行使因运营基金财产而产生的股权、债权及其他权利；
- 12、在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 13、依据《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会；
- 14、以基金管理人的名义，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；

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、在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；

17、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

1、遵守《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》；

2、依法募集基金，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、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；

5、对所管理的不同基金分别进行基金会计核算并编制财务会计报告及基金报告（包括半年度报告和年度报告）；

6、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项，严格按照《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的约定，履行信息披露及报告义务；

7、按照规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、依据《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会；在基金托管人依法召集或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的情况下，基金管理人有关义务予以配合；

9、负责基金注册登记，并严格按照《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的约定，配备足够的专业人员办理或委托经中国证监会认定的其他机构办理本基金的注册登记业务；

10、设置相应的部门并配备足够的专业人员，按照《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的约定办理或委托经中国证监会认定的其他机构办理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

11、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；

12、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；

13、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；

14、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资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

15、依法接受基金托管人依照法律法规和《基金合同》进行的监督；

16、因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿；

17、不谋求对上市公司的控股和直接管理；

18、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托其他人运作基金财产；

19、按照《基金法》及其他有关法律法规的规定保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》另有约定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不向他人泄露；

20、保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录 15 年以上；

21、参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

22、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并提前 15 天书面通知基金托管人；

23、因过错导致基金财产的损失，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

24、采取所有必要措施对基金托管人违反《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》和《托管协议》的行为进行纠正和补救，包括基金托管人因过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

25、确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

26、监督基金托管人按照基金合同的约定履行义务，基金托管人因违反基金合同的有关约定造成基金财产损失时，应为基金向基金托管人追偿，但不承担连带责任、赔偿责任及其他法律责任（法律法规另有规定除外）；

27、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

28、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》约定的其他义务；

七、基金托管人的权利与义务

（一）基金托管人的权利

- 1、自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定持有并安全保管基金财产；
- 2、依据《基金合同》的约定获取基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的收入；
- 3、依据《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》监督本基金的投资运作，如认为本基金或基金管理人的投资指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反《基金合同》的约定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告；
- 4、依据《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的约定，召集基金份额持有人大会；
- 5、在基金管理人职责终止时，提名新任基金管理人；
- 6、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定、约定的其他权利。

（二）基金托管人的义务

- 1、遵守《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》；
- 2、依法持有基金财产；
- 3、以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 4、设有专门的基金托管部，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；
- 5、除依据《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托其他人托管基金财产；
- 6、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- 7、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划

拨、账册记录等方面的完整与独立;

8、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;

9、以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户,以基金托管人及基金联名的方式开立基金证券账户,以基金的名义开立银行间债券托管账户,负责基金投资于证券的清算交割,执行基金管理人的划款指令,并负责办理基金名下的资金往来;

10、保守基金商业秘密,除《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;

11、按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告,复核基金业绩报告。对基金财务会计报告、半年度报告和年度基金报告出具意见,并报银行业监管机构和中国证监会;

12、采取适当、合理的措施,使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合《基金合同》等有关法律文件的规定;

13、采取适当、合理的措施,使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合《基金合同》等法律文件的规定;

14、采取适当、合理的措施,使基金投资和融资符合《基金合同》等法律文件的规定;

15、在基金定期报告内出具基金托管人意见,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;

16、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;

17、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格;

18、依基金管理人指令或有关规定将基金份额持有人收益和赎回款项自基金托管专户划出;

19、按有关规定,保存托管业务活动的基金的账册、报表和记录等 15 年以上;

20、按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

21、依据基金管理人的指令或有关规定支付基金份额持有人的收益和赎回款项;

22、参加基金清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

23、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会,并通知基金管理人;

24、因过错导致基金财产的损失,承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;

25、监督基金管理人按照《基金合同》的规定履行义务,基金管理人因过错造成基金财

产损失时，基金托管人应代表基金向基金管理人追偿；

26、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

27、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

28、接受基金管理人依照《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》进行的监督；

29、依法召集基金份额持有人大会，在基金管理人依法召集或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的情况下，基金托管人有义务予以配合；

30、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定、约定的其他义务。

八、基金份额持有人的权利与义务

（一）基金份额持有人的权利

- 1、分享基金财产收益；
- 2、取得基金清算后的剩余资产；
- 3、依法转让或者申请赎回其持有的基金份额，并在《基金合同》规定的时间取得有效申请的款项或基金份额；
- 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，并行使表决权；
- 6、监督基金经营情况，查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7、因基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构的过错导致利益受到损害，有要求赔偿的权利；
- 8、提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定的应尽义务；
- 9、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（二）基金份额持有人的义务

- 1、遵守《基金合同》；
- 2、缴纳基金认购、申购款项，承担《基金合同》规定的费用；
- 3、承担基金亏损或者基金合同提前终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- 5、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 6、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

九、基金份额持有人大会

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组成。

（一）有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1. 终止基金合同；
2. 变更基金类型或转换基金运作方式；
3. 变更基金投资目标或投资策略；
4. 变更基金份额持有人大会程序；
5. 更换基金管理人；
6. 更换基金托管人；
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. 本基金与其它基金的合并；
9. 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
10. 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

（二）以下情况不需召开基金份额持有人大会：

1. 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
2. 在法律法规和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. 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
4. 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
5. 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它情形。

（三） 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，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。

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（不含 10%）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（不含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

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

4.代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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

（四）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；
- 3.投票委托书送达时间和地点；
- 4.会务常设联系人姓名、电话；
- 5.有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6.如采用通讯表决方式，则载明投票表决的截止日以及表决票的送达地址；
7. 其他需要说明的事项。

（五）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托其代理人出席，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约定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

1.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，有代表 50%（不含 50%）以上基金份额的持有人参加基金份额持有人大会。

2.在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同约定公布会议通知后，在下一个工作日内公布相关提示性公告；

（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%（不含 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它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

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，否则表明符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（六）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后依照本条第（七）款和第（八）款的有关约定进行表决，并形成大会决议。

在通讯表决开会的方式下，依照本条第（七）款和第（八）款的有关约定进行表决。

（七）表决

1.基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 $\frac{2}{3}$ 以上（不含 $\frac{2}{3}$ ）通过。

（2）一般决议

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

转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4.采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

5.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。

6.基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

（八）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的授权代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人担任监票人。

（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。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

（1）由大会召集人授权的两名计票员在监督员监督下进行计票，并由公证机关对计票过程予以公证。

如果基金管理人或基金份额持有人为召集人，则由基金托管人的授权代表任监督员；如

果基金托管人为召集人，则由基金管理人的授权代表任监督员；如果基金管理人和基金托管人均未指派授权代表任监督员，则由基金份额持有人自行推举代表任监督员。

(2) 由大会召集人聘请的公证机关的工组人员进行计票。

(九) 生效与公告

1. 基金份额持有人大会按照《证券投资基金法》的有关规定及基金合同的有关约定表决通过的事项，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。

2. 基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。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在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

十、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序

（一）基金管理人和基金托管人的更换条件

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，须更换基金管理人：

- （1）基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- （2）依照《基金合同》规定由基金份额持有人大会表决解任的；
- （3）被依法取消其基金管理资格的；
- （4）《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的其他情形。

2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，须更换基金托管人：

- （1）基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- （2）依照《基金合同》的规定由基金份额持有人大会表决解任的；
- （3）被依法取消其基金托管资格的；
- （4）《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的其他情形。

（二）基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合《基金法》及其他有关法律法规和中国证监会规定的资格条件。

（3）临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

（4）批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金管理人经中国证监会批准方可退任。

（5）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体公告。原基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续；新任基金管理人应及时接收；如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金管理人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定

的信息披露媒体公告。

（6）审计：基金管理人职责终止的，应当按照《基金法》及其他有关法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告的同时报中国证监会备案。

（7）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的“嘉实”字样。

2、基金托管人的更换程序

（1）提名：新任基金托管人由基金管理人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后六个月内对被提名的基金托管人形成决议。

（3）临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人。

（4）批准：新任基金托管人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会批准方可退任。

（5）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体公告。原基金托管人应妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时与新任基金托管人进行基金财产和托管业务移交手续；新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金管理人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（6）审计：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。

十一、基金份额的集中发售

本基金集中发售期基金份额的发售时间、发售方式、发售对象，及集中发售期的购买和持有限额等，将由本基金招募说明书规定。

十二、基金的存续

（一） 基金合同的生效

在取得中国证监会对嘉实浦安保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议的书面核准文件之日后，并自原《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》规定的股票基金期开始之日起，本《基金合同》生效。

基金管理人在收到中国证监会核准文件的次日对本《基金合同》生效事宜予以公告。

（二） 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规另有规定时，从其规定。

十三、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的基金代销机构。

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

（二）申购与赎回办理的时间

1、开放日及开放时间

本基金将上海证券交易所、深圳证券交易所的每个交易日设为开放日，为投资者办理申购、赎回等基金业务。具体业务办理时间由基金管理人在《招募说明书》及更新招募说明书中规定。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整，并报中国证监会备案。

2、申购、赎回的开始时间

自《基金合同》生效日起不超过三个月内，在开放日开始办理申购、赎回。

3、在确定赎回或申购开始时间后，由基金管理人最迟于开始日期前 3 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。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、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、本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。

（四）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提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

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

基金管理人应当于受理基金投资者申购、赎回申请之日起 3 个工作日内，对申请的有效性进行确认。

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，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，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 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按《基金合同》有关规定处理。

（五）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、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整并报中国证监会备案，最迟在调整生效前 3 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。

（六）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份数的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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

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

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

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。

2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

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

赎回金额=赎回总额-赎回费用

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇市场中断事件等特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，由基金管理人支配使用，不列入基金资产。赎回费用由赎回人承担，其中不低于 25% 的部分归基金所有，其余部分可用于注册登记等相关费用。

5、本基金的申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。本基金的申购费率和赎回费率由基金管理人确定并在《招募说明书》或更新招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟须于新的费率开始实施前 3 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。

（七）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。投资者赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在《基金法》及其他有关法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 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。

（八）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的 10% 时，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份额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；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并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（九）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）不可抗力；
- （2）证券交易场所交易时间非正常停市；
- （3）基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有的基金份额持有人利益产生损害；
- （4）基金管理人和基金托管人认为会有损于已有基金份额持有人利益的其他申购；
- （5）《基金法》及其他有关法律法规规定或中国证监会规定的其它情形。

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）不可抗力；
- （2）证券交易场所交易时间非正常停市；
- （3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）《基金法》及其他有关法律法规规定或中国证监会规定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案；已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户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兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获

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。

3、发生《基金合同》、《招募说明书》或更新招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 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新的基金份额净值。

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 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体连续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新的基金份额净值。

（十）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届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

十四、基金的非交易过户与转托管

（一） 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式， 将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行、国有资产无偿划转、机构合并或分立及基金注册登记机构认可的其他行为。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。其中：

- 1、“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；
- 2、“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；
- 3、“司法强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；
- 4、“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；
- 5、“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转。

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

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

（四） 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构（网点）。

（五） 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一律转为基金份额并冻结。

（六） 根据相关法律法规的规定，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

十五、基金托管

本基金资产由基金托管人依法持有并保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定订立《托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金资产的保管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利和义务，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十六、基金销售业务

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。

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销售业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和基金代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金资产的安全，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《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金的销售业务。

十七、基金登记业务

本基金的注册登记业务指本基金登记、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、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

本基金的注册登记业务由基金管理人或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注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在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、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

注册登记机构享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、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；
- 3、《基金法》及其他有关法律法规规定的其他权利。

注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3、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；
- 4、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，但司法强制检查情形除外；
- 5、按《基金合同》及《招募说明书》、更新招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6、《基金法》及其他有关法律法规规定的其他义务。

十八、基金的投资

（一）、投资目标

力争为基金份额持有人创造长期超额收益。

（二）、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括：股票资产、衍生工具（权证、资产支持证券等）、债券资产（政府债券；金融债券；企业（公司）债券、可转债等）、债券回购、现金资产，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 60~95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%。

若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定，适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

（三）、投资理念

投资优质企业，获取长期回报；适度均衡配置，控制组合风险。

（1）企业的内在价值取决于其制度、人力、资产等资源的合理有效配置。优质企业往往具有完善的法人治理结构、清晰的发展战略和卓越的执行力。

（2）证券投资的超额收益主要来自于企业价值超过市场平均水平的持续增长，长期投资于优质企业能够分享企业价值增长带来的超额收益。

（3）在股票组合中，适度均衡配置各行业中的优质企业，减少熟悉度偏误（familiarity bias），从而控制组合风险。

（四）、投资策略

本基金在大类资产配置上，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类大类资产上。

除主要的股票投资策略外，本基金还可通过新股申购策略、债券投资策略、及衍生工具投资策略，如：可转债投资策略、权证及其他金融工具投资策略等辅助投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。

（1）股票投资策略

本基金以自下而上的个股精选策略为主，结合行业配置适度均衡策略，构造和优化组合，力争为基金份额持有人创造长期超额收益。

首先，在个股选择上，本基金采用自下而上的个股精选策略，通过“投资备选库流程”，强化投资纪律，保护组合质量，生成作为主要买入备选股票的“优质企业群”。

进而，在行业配置上，本基金采用行业配置适度均衡策略，通过滚动执行“行业配置流程”，确定或调整个股配置比例，从而构建组合、优化组合。

1) 个股选择

本基金采取自下而上的个股精选策略。自下而上的投资策略相信，无论经济环境或行业环境如何变化，总是有一些优质企业能超越其竞争组，获得高于市场平均水平的回报。因而，自下而上的研究方法，就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上，本基金执行“投资备选库流程”，包括：

第一步，在内部和外部的研究范围内，通过估值筛选和特殊环境分析，建立投资备选库：

- 估值筛选：分析 PE，PB，PCF，EV/EBITDA，ROE，ROA 等指标，选择估值水平较低或较合理的公司；
- 特殊环境分析：分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化，寻找从中受益的公司

第二步，从公司层面和股票层面，深度分析投资备选库内的股票，精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票：

- 从公司层面看，

一般情况下，“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的新兴行业，并具备较强的行业代表性；主要由渡过了初创期、具有较好业绩记录的公司组成；其中的大部分公司从事专业化经营。进入“优质企业群”的公司通常具备以下特征：

- ✧ 具备完善的法人治理结构和有效的激励机制；
- ✧ 拥有优秀的企业家或管理层，具有良好的业绩记录，管理层对所属行业有深刻

理解和较强的前瞻性,形成了清晰的发展战略及有利于提升投资者价值的盈利模式;

- ✧ 基本面正在改善;
- ✧ 比较包括 ROIC、企业加权平均资本成本 (WACC)、企业成长(G)等核心指标,具有中长期成长性;

● 从股票层面看,

进入“优质企业群”的个股,

- ✧ 比较动态市盈率、PEG 等指标,目前的估值水平明显偏低或相对合理,或
- ✧ 具有中短期市场表现的催化剂。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

2) 行业配置

在以自下而上的个股精选策略为主的基础上,本基金采取适度均衡的行业配置策略。

本基金行业配置的核心方法是:全面覆盖主要行业,适度均衡配置。充分借鉴内部和外部研究观点,动态跟踪行业景气度和估值水平,确定或调整行业配置比例,构建组合,并推进个股在组合层面的不断优化。

在行业配置上,本基金执行“行业配置流程”,包括:

第一步,通过持续的行业研究,形成行业配置比例:

- ✧ 建立行业景气度跟踪模型,找出各行业的核心驱动因素,对这些核心因素进行敏感性分析和持续跟踪,找出景气度最高和景气度变化最大的行业。其中,本公司定量分析小组将根据季度环比和同比的毛利率变动,外部分析师盈利预测调整,资金流向等指标提供景气度变化的相关信息;
- ✧ 全面跟踪行业估值水平,比较各行业的平均估值指标(动态市盈率,PEG,分红收益率等),找出估值水平相对较低的行业;
- ✧ 结合行业景气度和估值水平,确定阶段性重点关注的行业;
- ✧ 形成行业配置比例。

第二步,根据行业配置比例,以个股选择形成的“优质企业群”为主要买入备选股票,确定个股在组合中的配置权重,从而构建组合。

在行业配置调整上,本基金认为,持续的行业研究有利于减少投资盲点和行业偏离度。

因而，本基金通过滚动执行行业配置流程，带动重点行业配置的动态调整，促进投资备选库股票及“优质企业群”个股的相应调整，从而推动个股选择在组合层面的不断优化。

（2）权证及其他金融工具投资策略

本基金将按照相关法律法规，利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。

本基金在权证投资中，将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

（3）可转债投资策略

本基金在对可转换债券条款和发行债券公司的基本面进行深入研究的基础上，利用期权定价模型和正股估值模型等数量化工具进行估值分析；通过分析不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高的稳定回报。

（4）债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

（5）新股申购策略

本基金根据新股发行人的基本情况、对认购中签率和新股上市后表现的预期，择机参与新股申购，以取得比较稳定的收益增强。

（五）、业绩比较基准

业绩比较基准 = 沪深 300 指数×95% + 上证国债指数×5%

如果今后法律法规发生变化，或者市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经报中国证监会备案且及时公告。

（六）、风险收益特征

较高风险，较高收益。

（七）投资程序

- 1、公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。
- 2、在投资决策委员会的指导下，基金经理小组和资产配置小组综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断，按照《基金合同》的规定，提出下一阶段本基金投资组合中大类资产配置比例。并制订基金在重要股票资产类别上的具体配置计划。
- 3、投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略，审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。
- 4、基金小组根据投资决策委员会所做的决议，参考本公司研究部和其他研究机构的研究报告，选择具体的投资目标，构建投资组合。
- 5、设置独立的集中交易室，基金经理将投资指令下达给集中交易室，交易主管在复核投资指令合法合规的基础上，将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分隔。
- 6、风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。
- 7、基金小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，按照《基金合同》的规定对投资组合进行动态调整。
- 8、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。

（八）投资组合比例限制

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- 3、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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

（九）禁止行为

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

（十）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组合比例限制和禁止行为被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整投资组合比例限制和禁止行为规定。

（十一）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

- 1、不谋求对所投资企业的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益；
- 4、所有参与均在合法合规的前提下维护基金投资者利益并谋求基金资产的保值和增值。

十九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

二十、基金资产

（一）基金资产总值和基金资产净值

基金资产总值是指通过发售基金份额方式募集资金，并进行证券投资等交易所形成的各类资产的价值总和，包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款及其他投资等。

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（二）基金资产的保管及处分

本基金资产独立于基金管理人及基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押和其他权利。除依《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定处分外，基金资产不得被处分。

（三）基金资产的账户

本基金将按照有关规定开立基金银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人、基金代销机构和基金注册与过户登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

二十一、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与赎回提供计价依据。

（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以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值方法

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 未上市股票的估值

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

② 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；该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

④ 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 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；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券采用估值技术确定公允价值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)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)－(5)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；

(7) 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

未上市交易的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)停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、资产支持证券的估值方法

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

(2)全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5.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。

6.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。

(四)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

(五)估值程序

1.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。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放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) 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 4 位以内(含第 4 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1. 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)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,由差错责任方承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

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

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人、对外公告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。

(七) 暂停估值的情形

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

(八) 基金净值的确认

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

(九) 特殊情况的处理

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(6)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，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

二十二、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、投资交易费用；
- 4、基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的基金管理费

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。

基金管理费按前一日基金资产净值为基数计提。如费率为 1.5%，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中支付给基金管理人指定的帐户，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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3个工作日内从基金资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、本条第(一)款第3至第7项费用由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,列入当期基金费用。

(三) 不列入基金费用的项目

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

(四) 基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人、基金托管人可协商酌情调低基金管理费、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纳税主体,依照国家《基金法》及其他有关法律法规的规定履行纳税义务。

二十三、基金收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、法律法规及《基金合同》规定的其它收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 5、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，但每年至多分配六次。
- 6、本基金收益分配采用现金方式和红利再投资方式，基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益按照《基金合同》有关基金份额申购的约定转为基金份额，基金份额持有人未事先明确选择收益分配方式的，则默认为采用现金方式进行分配。
- 7、基金收益分配比例不得低于基金净收益的 20%；
- 8、《基金法》及其他有关法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案



基金收益分配方案须载明基金收益的范围、基金净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

二十四、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、会计制度按国家有关的会计制度执行；
- 4、本基金独立建账、独立核算；
- 5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、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；
- 6、基金托管人每月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）基金年度审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金进行年度审计；
- 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和基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 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。更换会计师事务所须在 5 个工作日内公告。

二十五、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（一）《招募说明书》和《基金份额发售公告》

基金管理人按照《基金法》及其他有关法律法规编制并公告《招募说明书》和《基金份额发售公告》。

（二）定期报告

本基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金净值公告及更新招募说明书，由基金管理人和基金托管人按照《基金法》及其他有关法律法规的规定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进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

- 1、年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的 90 日内公告；
- 2、半年度报告：基金半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；
- 3、季度报告：季度报告每季度公布一次，于截止日后 15 个工作日内公告；
- 4、基金净值公告：每开放日公布前一沪、深交易所交易日的基金份额净值；
- 5、更新招募说明书：《基金合同》生效后，在每六个月结束之日起 45 日内，对招募说明书进行更新，并在公告时间 15 日前报中国证监会审核。更新招募说明书将登载在公司网站上，更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。更新招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后一日；
- 6、《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（三）临时公告

基金在运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事项时，基金管理人须按照《基金法》及其他有关法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- （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百分之五十；
- (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百分之三十；
- (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百分之零点五；
- (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) 开放式基金开始办理申购、赎回；
- (22) 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 开放式基金暂停接受申购、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。

(四) 信息披露文件的存放与查阅

本基金《招募说明书》(包括更新招募说明书)、年度报告、半年度报告、季度报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金基金代销机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

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。

二十六、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、本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意；

2、变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，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变更后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

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

（3）基金存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人有权宣布本《基金合同》终止；

（4）相关法律、法规规定或许可的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。

（三）基金财产的清算

1、清算小组

（1）自基金合同终止之日起三个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师事务所、律师事务所等中介服务机构以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

2、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金资产；
- (2) 清算小组对基金资产进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行估价；
- (4) 对基金资产进行变现；
- (5) 清算组出具清算报告；
- (6) 清算组出具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) 清算后的剩余基金财产，按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金清算的公告

清算小组作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，报中国证监会备案后 5 个工作日内由清算小组公告。

6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

二十七、业务规则

《基金合同》当事人应遵守《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》。该规则由基金管理人在符合《基金法》及其他有关法律法规及《基金合同》规定的前提下制订，并由其解释与修改，但《业务规则》的修改若实质修改了《基金合同》，则应召开基金份额持有人大会，对《基金合同》的修改形成决议。

二十八、违约责任

（一）由于《基金合同》一方当事人的违约，造成《基金合同》不能履行或者不能完全履行的，由有违约的一方承担违约责任；如属《基金合同》双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会、中国银监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则投资或不投资造成的损失或潜在损失等。

（二）《基金合同》当事人违反《基金合同》，给其他当事人造成直接损失的，应进行赔偿。

（三）在发生一方或多方当事人违约的情况下，《基金合同》能继续履行的，应当继续履行。未违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。

二十九、争议处理

（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》有关的争议可首先通过友好协商解决。自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会的届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

三十、《基金合同》的效力

（一）《基金合同》经基金管理人与基金托管人双方盖章、双方法定代表人或其授权代理人签字报请中国证监会批准。投资者缴纳认购的基金份额的款项时，《基金合同》成立。

《基金合同》的有效期自《基金合同》第十二条所述生效之日起至本基金清算结束报中国证监会批准并公告之日止。

（二）《基金合同》自生效之日起对《基金合同》当事人具有同等法律约束力。

（三）《基金合同》正本一式六份，其中上报中国证监会持有两份，基金管理人和基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

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



三十一、基金管理人、基金托管人签章

（见下页）



(本页为签字盖章页)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

法定代表人或授权代理人

签字：

签订地：

签订日：2007 年 月 日

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

法定代表人或授权代理人

签字：

签订地：

签订日：2007 年 月 日