

# 海富通股票证券投资基金更新招募说明书

## (2007 年第 1 号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

### 重要提示

海富通股票证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2005 年 5 月 17 日出具的证监基金字【2005】85 号文件核准募集。本基金的基金合同于 2005 年 7 月 29 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通股票证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。本招募说明书所载内容截止日为 2007 年 1 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 月 31 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 海富通股票证券投资基金更新招募说明书目录

|       |                          |      |
|-------|--------------------------|------|
| 第一节   | 绪言 .....                 | 5-2  |
| 第二节   | 释义 .....                 | 5-2  |
| 第三节   | 基金管理人 .....              | 5-6  |
| 第四节   | 基金托管人 .....              | 5-15 |
| 第五节   | 相关服务机构 .....             | 5-23 |
| 第六节   | 基金的募集 .....              | 5-29 |
| 第七节   | 基金合同的生效 .....            | 5-33 |
| 第八节   | 基金份额的申购与赎回 .....         | 5-33 |
| 第九节   | 基金的转换 .....              | 5-40 |
| 第十节   | 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押 ..... | 5-44 |
| 第十一节  | 基金的投资 .....              | 5-46 |
| 第十二节  | 基金的业绩 .....              | 5-46 |
| 第十三节  | 基金的财产 .....              | 5-53 |
| 第十四节  | 基金资产的估值 .....            | 5-55 |
| 第十五节  | 基金的收益与分配 .....           | 5-59 |
| 第十六节  | 基金的费用和税收 .....           | 5-58 |
| 第十七节  | 基金的会计与审计 .....           | 5-62 |
| 第十八节  | 基金的信息披露 .....            | 5-63 |
| 第十九节  | 风险揭示 .....               | 5-66 |
| 第二十节  | 基金合同的终止和清算 .....         | 5-68 |
| 第二十一节 | 基金合同的内容摘要 .....          | 5-70 |
| 第二十二节 | 基金托管协议的内容摘要 .....        | 5-81 |
| 第二十三节 | 对基金份额持有人的服务 .....        | 5-89 |
| 第二十四节 | 其他披露事项 .....             | 5-91 |
| 第二十五节 | 基金管理人和基金托管人的更换 .....     | 5-93 |
| 第二十六节 | 招募说明书的存放及查阅方式 .....      | 5-95 |
| 第二十七节 | 备查文件 .....               | 5-95 |

## 第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《海富通股票证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通股票证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 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：

- |                    |                                    |
|--------------------|------------------------------------|
| <b>基金或本基金：</b>     | 指海富通股票证券投资基金；                      |
| <b>基金合同或本基金合同：</b> | 指《海富通股票证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充； |
| <b>招募说明书：</b>      | 指《海富通股票证券投资基金招募说明书》及其定期更新；         |

|                  |                                                                            |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| <b>托管协议：</b>     | 指《海富通股票证券投资基金托管协议》；                                                        |
| <b>发售公告：</b>     | 指《海富通股票证券投资基金基金份额发售公告》；                                                    |
| <b>中国证监会：</b>    | 指中国证券监督管理委员会；                                                              |
| <b>中国银监会：</b>    | 指中国银行业监督管理委员会；                                                             |
| <b>《证券法》：</b>    | 指《中华人民共和国证券法》；                                                             |
| <b>《合同法》：</b>    | 指《中华人民共和国合同法》；                                                             |
| <b>《基金法》：</b>    | 指《中华人民共和国证券投资基金法》；                                                         |
| <b>《运作办法》：</b>   | 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》；                                       |
| <b>《销售办法》：</b>   | 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》；                                       |
| <b>《信息披露办法》：</b> | 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》；                                     |
| <b>元：</b>        | 指人民币元；                                                                     |
| <b>基金合同当事人：</b>  | 指受本《基金合同》约束，根据本《基金合同》享受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；                 |
| <b>基金管理人：</b>    | 指海富通基金管理有限公司；                                                              |
| <b>基金托管人：</b>    | 指中国银行股份有限公司；                                                               |
| <b>注册登记业务：</b>   | 指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、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； |
| <b>注册登记人：</b>    | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人为海富通基金管理有限公司或接受海富通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；；    |
| <b>注册登记系统：</b>   | 指注册登记人的开放式基金注册登记系统；                                                        |
| <b>投资人：</b>      | 指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和                                                    |

- 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；
- 个人投资人：**指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定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证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；
- 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合法设立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：**指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
- 基金募集期：**指基金合同和《招募说明书》中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；
- 基金合同生效日：**指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
- 基金合同终止日：**指本基金合同规定的合同终止事由出现后按照本基金合同规定的程序终止基金合同的日期；
- 存续期：**指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 认购：**指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：**指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：**指基金份额持有人按本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；                                                                              |
| <b>巨额赎回：</b>   | 基金单个开放日，本基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回； |
| <b>基金转换：</b>   | 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、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金的基金份额的行为；           |
| <b>转托管：</b>    | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的的行为；                                                  |
| <b>投资指令：</b>   | 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；                                                     |
| <b>代销机构：</b>   | 指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；                                                |
| <b>销售机构：</b>   | 指基金管理人及本基金代销机构；                                                                                |
| <b>基金销售网点：</b> | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；                                                                       |
| <b>指定媒体：</b>   | 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；                                                                    |
| <b>基金账户：</b>   | 指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；                                            |
| <b>交易账户：</b>   | 指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；                                |
| <b>工作日：</b>    | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；                                                                        |
| <b>开放日：</b>    | 指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；                                                                         |

|                |                                                                                                |
|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>T 日：</b>    | 指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；                                                                     |
| <b>T+n 日：</b>  | 指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日                                                                        |
| <b>基金收益：</b>   | 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；                                                        |
| <b>基金资产总值：</b> | 指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；                                                  |
| <b>基金资产净值：</b> | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；                                                                             |
| <b>基金份额净值</b>  | 指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数；                                                                       |
| <b>基金财产估值：</b> | 指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；                                                           |
| <b>指定媒体</b>    | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网站及其他媒体；                                                                |
| <b>法律法规：</b>   | 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；                            |
| <b>不可抗力：</b>   | 指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，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。 |

## 第三节 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-68604999

联系人：江淼

注册资本：1.5 亿元

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、富通基金管理公司 49%。

## （二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997 年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加 (Stewart Edgar) 先生，董事，英国籍，学士。历任英国 Ivory & Sime 公共有限公司基金经理、美国 Fiduciary 国际信托公司研究部主任、高级副总裁、英国 HD 国际有限公司高级基金经理、董事、美国 F&C 管理公司高级基金经理、董事。1997 年至今任富通基金管理公司董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理学硕士。历任法国金融租赁 Euroequipment S.A. 公司总裁助理、富通银行区域经理、大中华地区主管、富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长、海通证券办公室主任、海通证券投资银行总部副总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长，现任中国民生银行党委书记、董事长、董事。



陈家强先生，独立董事，美国籍，博士，教授。历任美国俄亥俄州立大学财务学系副教授、香港科技大学财务学系教授、会计学系主任、香港科技大学工商管理学院副院长。现任香港科技大学财务学系主任、香港科技大学工商管理学院院长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事。比利时籍，经济学学士。历任比利时通用银行证券分析、基金管理、公司财务等领域的业务主管，资产管理部总经理，比利时布鲁塞尔自由大学经济系教授。现任欧洲投资基金及投资企业协会名誉主席，“养老金基金”委员会主席，欧盟委员会“养老金基金论坛”委员，欧洲议会“养老金基金论坛”委员，INVESTPROTECT 公司（布鲁塞尔）董事总经理。

杨国平先生，独立董事。硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任上海大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用（集团）股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券财务会计部总经理、海通证券财务副总监兼财务会计部总经理。

余毓繁先生，英籍华人，监事，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行亚洲区行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员，基金从业人员资格证书持有者，历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司稽核部稽核员。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理，监察稽核部负责人。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003

年 4 月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选基金基金经理，2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金基金经理，2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长基金基金经理，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007 年 2 月起，兼任海富通风格优势基金基金经理。

阎小庆先生，副总经理兼市场业务总监，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表，2003 年至今任海富通基金管理有限公司市场总监，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈家琳先生，特许金融分析师 (CFA)，1992 年获得华东师范大学文学士学位，于 2001 年获得香港大学—复旦大学 MBA 硕士学位。在加入海富通基金管理公司之前，先后在三和银行、嘉里证券和里昂证券从事商业银行信贷工作和证券市场的投资分析工作，在金融投融资领域积累了丰富的实践经验。2003 年至今任海富通基金管理有限公司股票分析师、中国股票研究负责人。

牟永宁先生，经济学硕士，10 年证券从业经历，持有基金从业人员资格证书和非执业注册会计师资格证书。历任申银万国证券研究所分析师、高级分析师、副经理，申万巴黎基金管理公司高级分析师，美林证券（亚太区）资产管理部、投资银行部实习经理。2004 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，任策略分析师，2005 年 9 月至今任海富通基金管理有限公司研究负责人。

本基金现任基金经理郑拓先生、蒋征先生，简历如下。

郑拓先生，CFA，美国芝加哥大学 MBA。历任君安证券公司黑龙江公司投资经理，广达投资公司投资经理，加拿大 Donier International 企业融资经理，美国 Robert W. Baird 投资银行基金分析师。2003 年 7 月加入海富通基金管理公司，任投资部股票分析师、海富通精选基金经理助理。2005 年 4 月至 2006 年 9 月任海富通精选基金经理，2006 年 5 月至 2006 年 9 月任海富通强化回报基金基金经理，2005 年 7 月至今任海富通股票基金基金经理，2006 年 10 月至今任海富通风格优势基金基金经理。

蒋征先生，工商管理硕士，持有基金从业人员资格证书，证券从业年限 9 年。历任中国保险信托投资公司业务经理，嘉实基金管理有限公司丰和基金基金经理

助理，2003 年 1 月至 2004 年 4 月任泰和基金基金经理，2004 年 8 月至 2006 年 5 月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金基金经理，2005 年 12 月至 2006 年 5 月任基金兴安基金经理。2006 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，2006 年 9 月起任海富通强化回报基金基金经理，2007 年 2 月起兼任海富通股票基金基金经理。

本基金的历任基金经理为陈洪，任职时间为 2005 年 7 月至 2006 年 9 月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，投资总监；陈家琳，研究负责人；牟永宁，研究负责人；杜晓海，定量分析师。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

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. 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. 编制半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 国务院证券监督管理机构规定基金合同约定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策

略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 用基金资产承销证券；
- (6) 用基金资产向他人贷款或提供担保；
- (7) 用基金资产从事无限责任的投资；
- (8) 用基金资产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- (9) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (10) 以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (12) 基金财产参与股票发行申购，所申报的金额超过基金的总资产，基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (13) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值超过本基金资产净值的10%；
- (14) 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，超过该证券的10%；
- (15) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
- (16) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

3. 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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；

- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### (五) 基金管理人的内部控制制度

#### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

- (1) 全面性原则：内部控制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，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性。

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

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

## 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) . 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) . 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、

投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) . 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上, 对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度, 并结合部门职责和业务运作的要求拟定, 其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合, 建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

### 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系, 董事会层面设立督察长, 管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部, 通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系, 对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈, 保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的风险委员会制定风险管理政策, 由管理层的风险管理委员会负责实施, 由风险管理部专职落实和监督, 公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施, 全面把握风险点, 将风险管理责任落实到人, 实现对风险的日常管理和过程中管理, 防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实, 通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查, 监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况, 识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险, 提出并完善公司各项合规性制度, 以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施, 由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能, 通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节, 对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法

性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四节 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”），基本情况如下：

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元

存续期间：持续经营

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

托管部门总经理：秦立儒

托管部门联系人：宁敏

电话：(010) 66594977

传真：(010) 66594942

发展概况：

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域，并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务。在近百年的岁月里，中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖，打



造了卓越的品牌，与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务，包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括存款、贷款、贸易相关服务和贸易融资、清算、托管等在内的各项金融产品和融资、财务解决方案。中国银行为个人客户提供包括储蓄存款、消费信贷、银行卡、个人理财、汇款等在内的各项金融服务。在多年的发展历程中，中国银行曾创造了中国银行业的许多第一，所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河，在业界独领风骚，享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域仍居领先地位。截至 2005 年底，中国银行境内外分支机构共有 11,646 个，其中境内分支机构 11,018 个，境外分支机构 627 个，是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念，不断向国际化一流大银行的目标迈进

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史，在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立，至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间，中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代，中国银行作为民族金融的支柱，以服务大众、振兴民族金融业为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。

新中国成立后，中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行，继续保持和发扬了顽强创业的企业精神，为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994 年随着金融体制改革的深化，中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化，与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年，中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势，中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年，中国银行成功重组了香港中银集团，将 10 家成员银行合并成当地注册的“中国银行（香港）有限公司”。2002 年 7 月，重组后的中国银行（香港）有限公司在香港联交所成功上市，成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004 年 7 月 14 日，中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，脱颖而出，作为我国银行业的优秀代表携手北京 2008 年奥运会，成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于 2003 年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银

行，围绕“资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行”的目标，进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制，稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004年8月26日，中国银行股份有限公司成立，中国银行成为国家控股的股份制商业银行，标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步，中国银行的历史翻开了新的一页。

2006年6月1日，中国银行在香港联交所成功挂牌上市，共集资754.27亿港元，创六年来全球最大股票发行记录。中国银行首次公开发行H股刷新多项记录，是迄今为止中国公司最大的股票发行项目，是除日本以外亚洲最大的股票发行项目，是全球金融业最大的股票发行项目。继成功发行H股并上市之后，2006年7月5日，中国银行在上海证券交易所成功发行A股，是中国资本市场第一家国有商业银行股，是全流通背景下的第一家“海归”股，是沪深股市第一权重股。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中，在“新兴+转轨”的中国资本市场股权分置改革的大趋势中，中国银行将创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章！

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从1990年以来，中国银行一直荣登《财富》500强排行榜；自1992年，中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为“中国最佳银行”或“中国最佳本地银行”，并于2005年被《欧洲货币》评为中国及香港“最佳商业银行”（2005年房地产奖项）；2004年及2005年，中国银行被《环球金融》杂志评为“中国最佳贸易融资银行”和“中国最佳外汇银行”；在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的“2005中国营销盛典”中，被评为“2005年度中国企业营销创新奖”（是获奖企业中唯一的金融企业）；2005年，被《中国人才》（《China Staff》）授予“中国大陆‘最佳人力资源战略奖’”，这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖；根据英国《金融时报》2005年8月进行的调查，中国银行是中国的十大国际品牌之一；另外，中国银行被国家工商总局授予“中国驰名商标”。世纪信誉，环球共享。中国银行将秉承“以客户为中心，以市场为导向，强化公司治理，追求卓越效益，创建国际一流大银行”的宗旨，依托其雄厚

的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验，竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务，与广大客户携手共创美好未来。

#### 财务概况：

2005 年，中国银行集团实现营业利润 647.44 亿元，比 2004 年增长 12%；净利润 275 亿元，比 2004 年增长 31%；总资产回报率和权益净回报率分别达到 0.72% 和 12.62%，同比提高 0.11 个百分点和 2.58 个百分点；资产质量持续改善，2005 年末不良贷款比率从 2004 年末的 5.12% 进一步下降到 4.62%。

#### （二）主要人员情况

肖钢先生，自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月，1981 年毕业于湖南财经学院，1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自 2004 年 8 月起担任中国银行副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月，1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司执行董事、副行长。自 2000 年 11 月起任中国银行副行长。1993 年 12 月至 2000 年 11 月任中国人民建设银行副行长，1987 年 12 月至 1993 年 12 月历任中国人民建设银行大连市分行行长、中国人民建设银行计算机中心主任、国际业务部总经理。李先生出生于 1955 年 4 月，1978 年毕业于南京气象学院。

秦立儒先生，自 2005 年 10 月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005 年 5 月至 2005 年 10 月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004 年 4 月至 2005 年 5 月任中国银行股份有限公司全球金融

市场部总经理。2002 年 7 月至 2004 年 4 月任中国银行（香港）有限公司资金部总经理；1999 年 6 月至 2002 年 7 月任香港中银集团外汇交易中心总经理；1997 年 9 月至 1999 年 6 月任广东省银行香港分行（香港中银集团）总经理；1995 年 11 月至 1997 年 9 月任中国银行总行资金部副总经理，主管全球资金交易；1991 年 5 月至 1995 年 11 月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理；1987 年 10 月至 1991 年 5 月历任中国银行总行资金部副处长、处长；1982 年 8 月至 1987 年 9 月任中国银行卢森堡分行外汇部经理；1978 年 2 月至 1982 年 7 月，先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于 1955 年 5 月，1978 年毕业于北京外贸学院。

### （三）证券投资基金托管情况

截止到 2006 年 6 月末，中国银行已托管景宏、同盛、同智、兴安、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币市场、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、天同 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、招商先锋、大成蓝筹稳健、湘财荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合股票型基金等 41 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队；并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 70 余人，其中硕士学历以上人员 21 人，具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

## （五）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系，以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是：以完善的内部控制组织体系为保障，以体现制衡原则、健全有效的制度为基础，以精细化的过程为着眼点，以激励约束机制和问责制为引导，以信息科技手段为依托，大力培育合规文化，努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标，中国银行从明确职责入手，完善内部控制组织体系建设；从制度建设入手，夯实内部控制基础；从细节入手，实现精细化的过程控制；从完善激励约束机制和问责制入手，引导内部控制目标的实现；从加强信息技术手段入手，提高内部控制水平和质量；从加强教育培训入手，促进合规文化的形成。

### 2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 8 月 26 日成立以来，按照国家有关法律法规制定了新的公司章程，形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1) 董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会，并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施，以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构，风险管理部拟订风险管理策略及工作计划，并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能，中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动，对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估，负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005 年 11 月，董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程，进一步明确内部稽核职能独立于业务部门，并由董事会

的稽核委员会领导,在董事会授权下,稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算,以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门,各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核,向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制,明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任,相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2) 中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任,管理本行风险的各个方面,包括风险管理策略、措施和信贷政策,并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行,决定内部控制基本制度,评估内部控制体系的有效性,以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷,督导改进措施的落实,审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划,制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度,并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构,该部负责管理法律风险、合规风险,并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理,以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策,制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构,该部按照资产负债管理委员会制订的政策,管理本行流动性,预测本行流动性的需求和风险,并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策,负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜,法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3) 托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内

部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

### 3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

### 4、其他事项

最近一年内,基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

### (六) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定,托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项,对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中,如发现基金管理人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,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五节 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼

法定代表人：邵国有

总经理：田仁灿

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】48 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

联系人：喻群

客户服务中心电话：021-38784858

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-68604999

传真：021-38780084

#### 2. 代销机构

##### (1) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

电话：010-66594905

联系人：王徽

##### (2) 交通银行股份有限公司

地址：上海市仙霞路 18 号银城中路 188 号



法定代表人：蒋超良

客户服务统一咨询电话：95559

电话：021—58781234

联系人：曹榕

**(3) 招商银行股份有限公司**

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：0755-83195876

客户服务中心电话：95555

联系人：刘衍波

**(4) 兴业银行股份有限公司**

地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：95561

联系人：陈晓瑾

**(5) 深圳发展银行**

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 (Frank Neil Newman)

客户服务统一咨询电话：95501

电话：0755—22166075

联系人：王敏

**(6) 海通证券股份有限公司**

地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021—53594566—4125

联系人：金芸

**(7) 东北证券有限责任公司**

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李树

电话：0431-5096710

联系人：高新宇

(8) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电话：021—62580818

联系人：芮敏祺

(9) 申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：王明权

电话：021—54033888

联系人：胡洁净

(10) 中信建投证券有限责任公司

地址：北京朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：黎晓宏

电话：010—65183888-86080

联系人：魏明

(11) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755—82943511

联系人：黄健

(12) 兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：021—68419974

联系人：杨盛芳

(13) 长江证券有限责任公司

地址：武汉市新华下路特 8 号

法定代表人：明云成

电话：027-65799560

联系人：毕艇

**(14) 联合证券有限责任公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马国强

电话：0755—82493561

联系人：盛宗凌

**(15) 广发证券股份有限公司**

地址：广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020—87555888—875

联系人：肖中梅

**(16) 东方证券股份有限公司**

地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人：王益民

电话：021-62476600-3003

联系人：吴宇

**(17) 国信证券有限责任公司**

地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833-2181

联系人：林建闽

**(18) 中国银河证券有限责任公司**

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

电话：(010) 66568587

联系人：郭京华

**(19) 平安证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：叶黎成

电话：95511

联系人：余江

**(20) 财通证券经纪有限公司**

地址：杭州市解放路 111 号财通证券

法定代表人：陈海晓

电话：0571-87925129

联系人：乔俊

**(21) 中信万通证券有限责任公司**

地址：青岛市市南区东海路 28 号

法定代表人：史浩民

电话：0532—023905

联系人：李锦

**(22) 天相投资顾问有限公司**

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

电话：010-84533151-822

联系人：陈少震

**(23) 华泰证券有限责任公司**

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-721

联系人：袁红彬

**(24) 光大证券有限责任公司**

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

法定代表人：王明权

电话：021—68768800

联系人：刘晨

**(25) 中信证券股份有限公司**

地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84864818

联系人：陈忠

**(26) 中银国际证券有限责任公司**

地址：上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：平岳

电话：021-68604866

联系人：张静 金坚

**(27) 世纪证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：段强

电话：0755-83199511

联系人：章磊

**(28) 中信金通证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-85783715

联系人：王勤

**(二) 注册登记人**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

法定代表人：陈耀先

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

**(三) 出具法律意见书的律师事务所**

北京市金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人：王玲

电话：010-58785588

传真：010-58785599

联系人：宋萍萍

联系电话：0755-82125533

经办律师：靳庆军、宋萍萍

#### **(四) 审计基金财产的会计师事务所**

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：上海市湖滨路 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：肖峰 陈玲

## **第六节 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，并经中国证监会证监基金字【2005】第 85 号文核准募集。

### **(二) 基金存续期间：不定期**

### **(三) 基金类型：契约型开放式**

### **(四) 募集方式：募集期内本基金管理人代销网点和直销中心将同时面向个人投资人和机构投资者公开发售本基金。**

### **(五) 募集期限：本基金自《招募说明书》（基金份额发售公告）公告之日起开始发售。本基金募集期限自本基金发售之日起不超过 3 个月。本基金的实际募集期限为 2005 年 6 月 10 日至 2005 年 7 月 22 日。**

### **(六) 募集对象：本基金份额的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资人、和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止投资证券投资基金的除外）及合格境外机构投资者。**

(七) **募集场所**：本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售。

(八) **基金的最高募集规模**：本基金不设最高募集规模。

(九) **基金的面值、计算公式及认购费**

1. 基金份额面值：1.00 元人民币

2. 认购费

本基金认购费率不高于 1.2%，具体费率结构如下表。认购费用于本基金的市场推广、销售、注册登记等设立募集期间发生的各项费用。

| 业务类型 | 金 额                                    | 费率            |
|------|----------------------------------------|---------------|
| 认购   | $M \geq 500$ 万                         | 按笔收取，1000 元/笔 |
|      | $200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ | 0.5%          |
|      | $100 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$ | 0.8%          |
|      | $50 \text{ 万} \leq M < 100 \text{ 万}$  | 1.0%          |
|      | $M < 50 \text{ 万}$                     | 1.2%          |

3. 认购份额的计算

本基金采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。

投资人多次认购本基金的，注册登记人根据单次认购金额确定每次认购所适用的费率。计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费 = 认购金额 × 认购费率 / (1 + 认购费率)

认购份额 = (认购金额 - 认购费 + 认购利息) / 基金份额面值

认购费以人民币元为单位，以四舍五入方式保留至小数点后第 2 位；认购份额以四舍五入的方式保留至小数点后第 2 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。

(十) **投资人对基金份额的认购**

1. 认购时间安排

本基金募集期自发售之日起最长不超过 3 个月，募集期自 2005 年 6 月 10 日起至 2005 年 7 月 22 日止。

2. 在代销机构的认购程序

(1) 存入足够资金

投资人向其在代销机构的存款（资金）帐户内存入足额认购资金。如没有资金帐户，应先开立资金帐户，并存入足额资金。

## （2）开户（T 日）

个人投资人须持存款帐户卡、个人有效身份证件到代销网点开立基金帐户。委托他人代办的，代办人还需提交有效身份证件、授权委托书。

机构的经办人携带经办人有效身份证件及其复印件、存款帐户印鉴及印鉴卡、法人授权书并加盖公章、营业执照副本并由法定代表人签字或盖章及其复印件并加盖公章等相关证明文件到代销网点开立基金帐户。

## （3）认购（T 日）

投资人在开户的同时可以填写认购申请表，办理基金的认购手续。系统核验投资人资金，若足额则受理申请，为投资人打印受理回执。

## （4）查询（T+2 日 9:30 以后）

投资人可以通过其原认购网点柜台或海富通基金管理有限公司客户服务中心，查询认购申请的受理情况。

## （5）确认

基金募集期结束，若基金合同生效，投资人可到原认购网点柜台打印认购确认单；或通过海富通基金管理有限公司客户服务中心查询最终认购确认情况。

# 3. 在直销机构的认购程序

## （1）存入足够资金

投资人先将足够资金汇入海富通基金管理有限公司直销中心指定的基金认购资金专户。

## （2）开户（T 日）

投资人须持有有效证件到海富通基金管理有限公司直销中心填写《基金帐户注册申请表》，申请开立基金帐户，然后申请开立基金交易帐户。基金交易帐户和基金帐户的投资人姓名、证件类型和号码必须完全一致。

有效证件包括：个人有效身份证件（身份证、军官证、士兵证、武警证等）；委托他人代办的，代办人有效身份证件、授权委托书；机构有效证件包括：有效营业执照副本及其复印件（加盖公章）、民政部门或其他主管部门有效注册登记证书副本及其复印件（加盖公章）、预留印鉴、法人授权委托书（加盖公章，并



由法定代表人签字或盖章)、经办人有效身份证件及其复印件。

投资人完成开立基金帐户后,如需开通电话、传真、网上交易等服务,则须向海富通基金管理有限公司的直销中心提出申请办理相关手续并签署电话、传真、网上交易等服务协议文本(查询服务不需要签约),所提供资料同开户手续。

运作员检查申请人提交的《开放式基金账户类业务申请书》和相关文件合格后受理申请,出具受理回单,并加盖业务专用章,同时将申请书第三联交投资人留存,第二联和第一联交海富通基金管理有限公司直销中心留存。

### (3) 认购(T日)

投资人在开户的同时可以填写《开放式基金交易类业务申请书》,并提供银行转帐凭证办理基金的认购手续。运作员核验其资金到帐后,受理申请,出具受理回单,并加盖业务专用章,同时将申请书第三联交投资人留存,第二联和第一联交海富通基金管理有限公司直销中心留存。

如投资人已签署传真服务协议,也可以通过传真方式办理基金的认购手续。

投资人也可以预约认购,填写预约的认购截止日,采取先申请后到帐的方式认购基金。只要资金在投资人预约的认购截止日之前到帐,认购即生效。

### (4) 查询(T+2日9:30以后)

投资人可通过海富通基金管理有限公司的直销柜台、客户服务中心或网上交易系统查询认购申请在注册登记人的受理情况。

### (5) 确认

基金募集期结束后,若基金合同生效,海富通基金管理有限公司注册登记中心在认购期结束后三十日内为投资人寄送对账单,投资人也可以通过海富通基金管理有限公司直销柜台、客户服务中心或网上交易系统查询最终认购确认结果。

## 4. 认购限制

(1) 投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但一经受理的认购申请,就不得撤销。

(2) 在募集期内,投资人在代销机构销售网点单次认购的最低金额为1000元。

## 5. 超比例的处理方式

本基金募集期间内不设最高认购份额限制。

### **(十一) 募集资金利息的处理方式**

基金募集期间认购资金利息在募集期结束时归入投资人认购金额中,折合成基金份额,归投资人所有。

基金募集期间募集的资金存入专门帐户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

## **第七节 基金合同的生效**

### **(一) 基金合同的生效**

基金募集期限届满具备下列条件的,基金管理人应当自募集期限届满之日起十日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起十日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续,并予以公告:

1、在募集期限内基金募集份额总额不少于两亿份,基金募集金额不少于两亿元人民币;

2、基金份额持有人的人数不少于两百人;

基金备案获中国证监会书面确认之日起,基金合同生效。

### **(二) 基金募集失败**

1. 募集期满,未达到基金合同生效条件,或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力,则基金募集失败。

2. 本基金合同不生效时,基金管理人应承担因募集行为而产生的债务和费用,将投资人已缴纳的认购款项加计银行同期存款利息在募集期限届满后三十日内返还基金认购人。

3. 基金募集失败,基金管理人及托管人不得请求报酬。

**(三) 本基金合同已于2005年7月29日生效。**

## **第八节 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代销机构。

投资人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

本基金为投资人办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。在开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。

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提前公告，同时报中国证监会备案。

### 2. 申购的开始时间

本基金自2005年8月3日开始办理申购。

### 3. 赎回的开始时间

本基金自2005年9月12日开始办理赎回。

4. 投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回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。

## （三） 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购、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. “金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 基金份额持有人赎回基金份额，注册登记系统遵循“先进先出”的原则，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的费率；

4. 当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

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，但最迟须在新的原则实施三个工作日前在至少一种指定媒体予以公告。

#### **(四) 申购与赎回的程序**

##### **1、 申购与赎回申请的提出**

投资人须按照销售机构的规定,在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请,并办理有关手续。

投资人提交申购申请时,须按销售机构规定的方式备足申购资金;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与通知**

对投资人在T日规定时间内受理的申请,正常情况下,本基金注册登记人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认,投资人可在T+2日到销售网点或销售机构规定的其他方式查询申购、赎回的确认情况。

##### **3、 申购与赎回款项支付的方式与时间**

申购采用全额缴款方式,投资人交付款项后,申购申请即为有效,若申购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,申购款项将退回投资人账户。

投资人赎回申请成功后,赎回款项将于T+7日内划入赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回时,赎回款项的支付办法按照基金合同及本招募说明书的有关规定处理。

#### **(五) 申购和赎回的数额和价格**

##### **1、 申购金额、赎回份额及余额的处理方式**

(1) 投资人每次最低申购金额为1000元。

(2) 基金份额持有人在销售机构赎回时,每次赎回申请不得低于1000份基金份额;基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足1000份的,需一次全部赎回。

(3) 基金份额持有人在单个销售机构处持有本基金的最低份额为1000份。基金份额持有人因赎回后导致其基金账户内在该销售机构处剩余的基金份额低于1000时,注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

(4) 基金管理人可根据市场情况,调整以上申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制,并于调整三个工作日前在中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## 2、 申购份额的计算

本基金采用前端收费模式，即在申购基金时缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。计算方法如下：

$$\text{申购价格} = \text{申购日基金份额净值} \times (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购价格}$$

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

申购份额以四舍五入的方式保留至小数点第 2 位，由此产生的误差在基金资产中列支。

## 3、 赎回金额的计算

$$\text{赎回价格} = \text{赎回日基金份额净值} \times (1 - \text{赎回费率})$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回价格}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times \text{赎回日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

赎回金额以四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位，由此产生的误差在基金资产中列支。

## 4、 基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。计算公式为：

$$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金份额的余额数量}$$

## (六) 申购与赎回的费用

1、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。基金赎回费用由赎回人承担，在扣除必要的手续费后，赎回费余额不得低于赎回费总额的 25%，并归入基金财产。

2、根据基金合同的规定，本基金申购费率不超过 1.5%，赎回费率不超过 0.50%。

3、申购费率按照申购金额逐级递减，投资人在一天之内如果有多笔申购，按单笔确定所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

| 业务类型 | 金 额 (M)                                | 费率            |
|------|----------------------------------------|---------------|
| 申购   | $M \geq 500 \text{ 万}$                 | 按笔收取，1000 元/笔 |
|      | $200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ | 0.6%          |

|  |                      |      |
|--|----------------------|------|
|  | 100 万 $\leq$ M<200 万 | 1.0% |
|  | 50 万 $\leq$ M<100 万  | 1.2% |
|  | M<50 万               | 1.5% |

4、赎回费率按照持有时间逐级递减。本基金赎回费率按持有期分档如下：

| 业务类型 | 持有期             | 费率    |
|------|-----------------|-------|
| 赎回   | 小于 6 个月         | 0.35% |
|      | 6 个月（含）以上，1 年以下 | 0.18% |
|      | 1 年（含）以上，2 年以下  | 0.09% |
|      | 2 年（含）以上        | 0%    |

5、在遵守法律法规及基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对特定时间范围、特定地域范围、特定行业、特定职业等的投资人或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资人等定期或不定期地开展。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率、赎回费率。

6、基金管理人可以在基金合同规定的费率限额内自行决定调整申购或赎回费率，并最迟于新费率开始实施三个工作日前在至少一种指定媒体予以公告。

### （七）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人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、投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施三个工作日前予以公告。

### （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（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总

数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过上一日基金总份额的 10%时, 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人的全部赎回申请时, 按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回: 当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请有困难, 或认为兑付投资人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, 确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额; 当日未能赎回部分, 投资人在提交赎回申请时应做出延迟或取消赎回的明示, 未予明示的, 注册登记系统默认延迟赎回。选择延迟赎回的, 当日未办理部分延迟至下一开放日办理, 赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权, 以此类推, 直到全部赎回为止。选择取消赎回的, 当日未能赎回部分将予以撤销。

3) 当发生巨额赎回并延期办理时, 基金管理人应当通过招募说明书规定的方式, 在三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; 已经确认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二十个工作日, 并应当在中国证监会指定媒体公告。

## (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人的申购申请:

- 1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请;
- 2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市;

3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；  
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) 法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市；
- 3) 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财产估值情况；
- 5) 基金管理人认为有正当理由需要暂停接受基金赎回申请的；
- 6) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

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。已经确认的赎回申请，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。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停期间结束，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，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

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工作日的基金份额净值。

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。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在中国证监会指定报刊或其他相关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近一个工作日的基金份额净值。

## 第九节 基金的转换

### （一）基金转换

基金转换是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某一基金（包括本基金）的基金份额转为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金（包括本基金）的基金份额的行为。

### （二）基金转换申请人的范围

任何基金的持有人均可以按照《基金合同》的规定申请和办理基金转换。

### （三）基金转换受理场所

基金转换将通过基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点进行。

### （四）基金转换受理时间

在确定基金转换开始时间后，由基金管理人最迟于该开始时间前 3 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。具体办法由基金管理人在招募说明书中规定。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

本基金于 2005 年 7 月 30 日刊登公告，从 2005 年 8 月 3 日开始正式推出了本基金与本基金管理人管理的其他证券投资基金间的基金转换业务。

### （五）基金转换费用

除本基金外，基金管理人目前管理着海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金和海富通风格优势股票型证券投资基金五只开放式基金。本基金与该五只基金间的转换费率按如下规定执行；基金管理人可以根据市场情况调整转换费率，但最迟须于新的费率开始实施三个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

1、本基金与海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金间的转

换

对于每个基金账户，在每个会计年度内（1月1日至12月31日），本基金与海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金之间的转换，按以下费率执行：

| 转换情况   | 适用费率 |
|--------|------|
| 第一次转换  | 0.1% |
| 第二次转换起 | 0.3% |

转换费的 25% 计入转出基金资产。

## 2、本基金与海富通货币市场证券投资基金的转换

本基金份额转为海富通货币市场证券投资基金份额：适用本基金的赎回费率，赎回费的 25% 计入本基金资产。

海富通货币市场证券投资基金份额转为本基金份额：适用本基金的申购费率。

## （六）基金转换公式

### 1、基金的转换公式为：

$$A=[B \times C \times (1-D)] \div E$$

其中，

A 为转入基金的基金份额数量；

B 为转出基金的基金份额数量；

C 为转换日转出基金的基金份额净值；

D 为转换费率；

E 为转换日转入基金的基金份额净值。

转入份额以四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位。

例：假定投资人提出将所持有的海富通股票证券投资基金转换成海富通精选证券投资基金。

假定 T 日的两基金份额资产净值分别为 1.100 元和 1.200 元，转换份额为 100 万份，假设转换费率为 0.3%，那么转换申请所负担的转换费和相应的基金份额数等数值计算如下：

B 1,000,000

C 1.100

D 0.4%

E 1.200

A 913,916.67

即该投资人所持有的海富通股票证券投资基金减少 100 万份,同时增持海富通精选证券投资基金 913,916.67 份,转换费为 3300 元。

2、基金管理人在不损害各基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式,但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

### **(七) 基金转换的程序**

#### **1. 基金转换的申请方式**

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续,在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

#### **2. 基金转换申请的确认**

基金管理人应以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日(T 日),并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。

基金转换所涉及的两只基金,其中任何一只处于封闭期、暂停赎回期等非开放日,或者转换申请份额处于冻结状态,基金转换都不予确认。

基金转换申请日发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回的,基金转换不享有优先出来权,也将部分转换,但当日未获办理的基金转换份额将自动予以撤销,不再视为下一开放日的基金转换申请。

投资人可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

### **(八) 基金转换的数额限制**

本基金遵循“份额转换”的原则,单笔基金转换申请份额不得低于 1000 份,在一个销售机构的最低持有份额不得低于 1000 份。若基金份额持有人的某笔基金转换将导致其在该销售机构所持有的剩余基金份额低于 1000 份的,应申请一并转换,否则,注册登记系统可自动对该剩余份额做强制赎回处理。

### **(九) 基金转换的注册登记**

1. 基金投资人提出的基金转换申请,在当日交易时间结束前可以撤销,交

易时间结束后即不得撤销。

2. 基金份额持有人申请基金转换成功后，基金注册登记人在 T+1 工作日为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

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

#### **(十) 拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式**

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受各基金份额持有人的基金转换申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市；
- (3) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；
- (4) 基金管理人有权正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2、暂停基金转换，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

3、暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

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指定信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，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，重新开放基金转换时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换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，重新开放基金转换时，基金管理人应提前三个工作日在至少一种指定信息披露媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

## 第十节 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

### （一）非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、强制执行，及基金注册登记人认可的其它行为。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. “遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；
4. “自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；
5. “分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；
6. “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；
7. “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；
8. “资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；
9. “机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导

致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；

10. “企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；
11. “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。

办理非交易过户业务必须提供基金注册与过户登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册与过户登记人申请办理。

## （二）转托管

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购基金份额，但在赎回的情况下，必须向原申购的销售机构申请办理相应部分基金份额的赎回手续。

投资者申购基金份额后可以向原申购基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

转托管在转出方进行申报，基金份额转托管经一次申报便可完成。投资者于T日转托管基金份额成功后，转托管份额于T+1日到达转入方网点，投资者可于T+2日起赎回该部分基金份额。

## （三）冻结与质押

基金注册登记人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。

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金注册登记人可以办理基金份额的质押业务，并制订公布并实施相应的业务规则。

## 第十一节 基金的投资

### （一）投资目标

精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合,分享中国经济高速成长的成果,谋求基金资产的长期最大化增值。

### （二）投资方向和范围

本基金为股票型基金。本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的基本范围:股票资产 70%-95%,权证投资 0-3%,一年期以内的政府债券和现金的比例不低于 5%。

### （三）投资理念

在世界分工和国际经济结构调整的大背景下,深入研究国际及国内经济发展趋势、政策导向和市场环境等因素,及时把握中国经济发展的主要脉络,发掘处于不同景气周期中的相关上市公司的投资价值,获取长期稳定的回报。

### （四）投资策略

#### 1、决策依据

- （1）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- （2）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- （3）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

#### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下:

（1）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规,决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策;决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整;对旗下基金重大投资的批准与授权等。

（2）投资总监在公司有关规章制度授权范围内,对重大投资进行审查批准;并且根据基金合同的有关规定,在组合业绩比较基准的基础上,制定各组合资产

和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确定公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

### 3、投资管理方法

本基金采用双层次的投资策略。具体来说：

**第一层次**主要通过对股票市场的系统性风险进行分析，确定股票和现金资产的配置比例。本基金通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，全面评估证券市场系统性风险程度和资本市场中长期预期收益率，在设定的投资范围内调整股票与现金资产的比例，适度控制系统性风险。

**第二层次**主要是通过对行业景气循环和个股的研究，精选适合本投资组合风险收益特征的股票。公司认为，在不同的经济发展阶段、政策导向和市场环境下，会形成不同的投资环境和处于不同景气循环周期的产业群，给上市公司带来不同的投资机会。

本基金将采用自上而下的行业分析方法，从经济发展的不同阶段出发，结合对政策导向和市场环境等因素的综合分析，来判断各行业处于何种景气循环阶段。然后，对于不同行业景气度的行业采用自下而上的方法精选不同的上市公司。



### (1) 景气上升期

#### ■ 具有成本、技术和市场优势的行业龙头上市公司

处于景气上升期的行业，其行业的总体规模迅速扩大，毛利率水平也在上升，整个行业的利润水平快速提高。此时行业内的龙头上市公司具有技术、成本、资源、品牌和营销优势，不仅能分享行业高成长的成果，提高毛利率水平和生产规模，而且能低成本扩大自己的市场占有率。

#### ■ 具有独特竞争优势或在细分市场取得领先地位的高成长公司

对于景气上升行业中的非龙头上市公司，因整个行业的规模在迅速扩大，来自竞争对手，特别是行业内龙头上市公司的竞争压力大大减轻。该公司若能仅仅围绕自身的竞争优势确立有效的竞争策略，就可在某一个或几个细分市场获得领先优势，并且实现高速增长。

### (2) 景气平稳期

#### ■ 盈利稳定、估值水平合理、有丰厚现金分配的行业龙头公司

处于景气平稳期的行业，市场规模和利润水平保持稳定。行业内的发展机会主要来自于各企业市场份额的此消彼长和对新的细分市场的争夺。行业内的龙头公司，可以通过自己在行业内的支配地位，利用机会扩大市场份额。

#### ■ 处于高成长期的细分市场中的高成长公司

随着技术的进步，市场和消费结构的变化，即使处于景气平稳期的行业，也经常会出现新的高成长的子行业。行业内的龙头公司，因盈利已较稳定，市场份额较大，往往对新的子行业的投资机会不敏感。行业内的二线公司，如果能因应市场的变化而抓住新的投资机会，迅速在新的细分行业中取得领先优势，就可以成为新的行业龙头。

### (3) 景气下降期

#### ■ 基本面有重大改观，而股票价格尚未充分反映其基本面的变化的公司。

处于景气下降期的行业，市场份额会不断萎缩，投资在很多情况下为负增长。行业内的企业为生存而战，价格战此起彼伏，行业整合加速，部分企业退出市场。此类行业的投资机会主要来自部分公司退出本身所在的行业而进入其他景气度高的行业，或因股东的变更或资产的置换等方面的变化而彻底改变了行业内的竞争地位。

#### 4、权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略,以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的;在个股层面上,充分发掘可能的套利机会,以达到增值的目的

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证,并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

#### (五) 业绩比较基准

1) 本基金股票投资部分的业绩比较基准是 MSCI China A 指数,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。

**基金业绩比较基准=80%MSCI China A+20%上证国债**

如果未来我国证券市场推出更具代表性的业绩比较基准,本基金可以在履行适当的程序后变更基金业绩比较基准。

2) 本基金管理人认为,适用于本基金的业绩比较基准应符合下列条件:

- 1、合理、透明,为广大投资人所接受;
- 2、有一定市场覆盖率,并且不易被操纵;
- 3、业绩基准的编制和发布有一定的历史;
- 4、业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

因此,本基金选择 MSCI China A 指数作为股票投资部分的业绩基准,选择上证国债指数作为基金债券投资部分的业绩基准。

#### (六) 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的股票型基金产品。

#### (七) 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) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、

基金托管人发行的股票或者债券；

6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、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) 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，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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) 运用基金财产进行权证投资时，不得有下列情形：

(1) 在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

(2) 持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。

(3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，超过该权证的百分之十。

5) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、如果法律法规对本基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

## (八) 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六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。

## (十) 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或者进行直接管理；
- 2、所有参与均在合法合规的前提下维护基金投资人利益并谋求基金资产的保值和增值。

### (十一) 基金投资组合报告

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 2 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2006 年 12 月 31 日（“报告期末”）

#### 1、报告期末基金资产组合情况

| 项目           | 金额（元）            | 占基金资产总值比例 |
|--------------|------------------|-----------|
| 股票           | 2,673,111,720.72 | 69.47%    |
| 债券           | 150,048,389.20   | 3.90%     |
| 银行存款和清算备付金合计 | 782,171,521.23   | 20.33%    |
| 应收证券清算款      | 0.00             | 0.00%     |
| 权证           | 41,832,601.50    | 1.09%     |
| 其他资产         | 200,481,117.80   | 5.21%     |
| 合计           | 3,847,645,350.45 | 100.00%   |

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业             | 市值（元）          | 占基金资产净值比例 |
|----------------|----------------|-----------|
| A 农、林、牧、渔业     | 0.00           | 0.00%     |
| B 采掘业          | 219,152,399.61 | 6.03%     |
| C 制造业          | 955,513,479.31 | 26.31%    |
| C0 食品、饮料       | 306,477,390.70 | 8.44%     |
| C1 纺织、服装、皮毛    | 0.00           | 0.00%     |
| C2 木材、家具       | 0.00           | 0.00%     |
| C3 造纸、印刷       | 0.00           | 0.00%     |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 8,075,893.00   | 0.22%     |
| C5 电子          | 3,245,828.90   | 0.09%     |
| C6 金属、非金属      | 115,907,324.66 | 3.19%     |

|                  |                  |        |
|------------------|------------------|--------|
| C7 机械、设备、仪表      | 471,929,865.68   | 12.99% |
| C8 医药、生物制品       | 49,877,176.37    | 1.38%  |
| C99 其他制造业        | 0.00             | 0.00%  |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 49,542,200.00    | 1.36%  |
| E 建筑业            | 0.00             | 0.00%  |
| F 交通运输、仓储业       | 198,927,449.91   | 5.48%  |
| G 信息技术业          | 34,407,740.80    | 0.95%  |
| H 批发和零售贸易        | 201,975,066.63   | 5.56%  |
| I 金融、保险业         | 491,730,652.52   | 13.54% |
| J 房地产业           | 235,103,649.52   | 6.47%  |
| K 社会服务业          | 16,794,852.02    | 0.46%  |
| L 传播与文化产业        | 54,692,000.00    | 1.51%  |
| M 综合类            | 215,272,230.40   | 5.93%  |
| 合计               | 2,673,111,720.72 | 73.60% |

## 3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）         | 市值（元）          | 市值占基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|---------------|----------------|-------------|
| 1  | 000858 | 五 粮 液 | 8,972,204.00  | 205,014,861.40 | 5.64%       |
| 2  | 000793 | 华闻传媒  | 18,130,000.00 | 163,532,600.00 | 4.50%       |
| 3  | 601398 | 工商银行  | 23,020,520.00 | 142,727,224.00 | 3.93%       |
| 4  | 000002 | 万 科 A | 7,999,996.00  | 123,519,938.24 | 3.40%       |
| 5  | 600030 | 中信证券  | 4,424,842.00  | 121,152,173.96 | 3.34%       |
| 6  | 000157 | 中联重科  | 4,879,356.00  | 108,468,083.88 | 2.99%       |
| 7  | 600016 | 民生银行  | 10,030,000.00 | 102,306,000.00 | 2.82%       |
| 8  | 600616 | 第一食品  | 6,869,942.00  | 95,492,193.80  | 2.63%       |
| 9  | 600019 | 宝钢股份  | 10,582,601.00 | 91,645,324.66  | 2.52%       |
| 10 | 600428 | 中远航运  | 7,971,648.00  | 86,651,813.76  | 2.39%       |

## 4、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值（元）          | 占基金资产净值比例 |
|----|------|----------------|-----------|
| 1  | 国 债  | 150,048,389.20 | 4.13%     |
|    | 合 计  | 150,048,389.20 | 4.13%     |

## 5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

| 序号 | 债券名称 | 市值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|-------|-----------|
|----|------|-------|-----------|

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| 1 | 20 国债(10) | 99,798,389.20 | 2.75% |
| 2 | 02 国债(14) | 50,250,000.00 | 1.38% |

6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细

| 序号 | 权证代码   | 权证名称    | 投资类别 | 数量           | 市值（元）         | 占基金资产净值比例 |
|----|--------|---------|------|--------------|---------------|-----------|
| 1  | 030002 | 五粮 YGC1 | 被动持有 | 40,000.00    | 580,000.00    | 0.02%     |
| 2  | 030002 | 五粮 YGC1 | 主动持有 | 2,845,007.00 | 41,252,601.50 | 1.13%     |

7、投资组合报告附注

- 1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,没有有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
- 2) 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。
- 3) 基金的其他资产构成

单位：元

| 项目     | 金额             |
|--------|----------------|
| 交易保证金  | 638,549.12     |
| 应收股利   | 0.00           |
| 应收利息   | 808,873.00     |
| 应收申购款  | 199,033,695.68 |
| 其他应收款  | 0.00           |
| 买入返售证券 | 0.00           |
| 合计     | 200,481,117.80 |

- 4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细  
无

## 第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为2006 年12月31日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

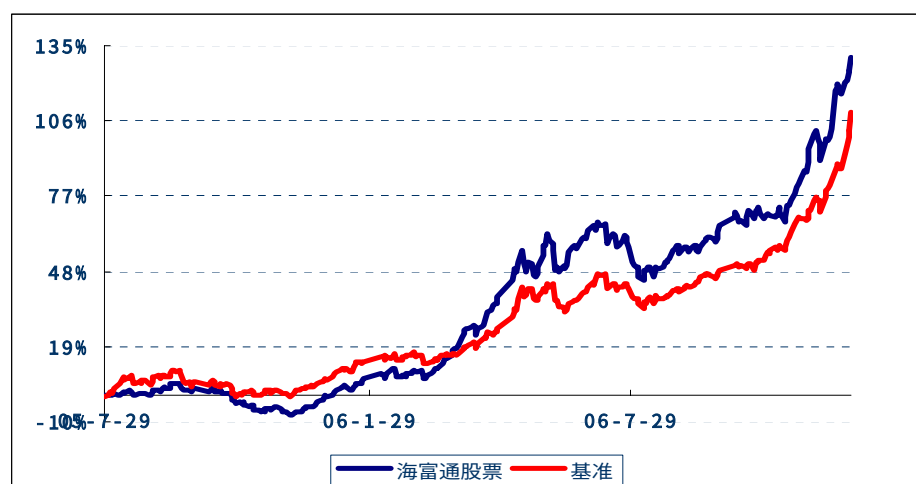
| 阶段 | 净值增长率 (1) | 净值增长率标准差 (2) | 业绩比较基准收益率 (3) | 业绩比较基准标准差 (4) | (1)－(3) | (2)－(4) |
|----|-----------|--------------|---------------|---------------|---------|---------|
|----|-----------|--------------|---------------|---------------|---------|---------|

|                |         |       |         |       |        |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去 1 个月        | 18.06%  | 2.17% | 21.93%  | 1.47% | -3.87% | 0.70% |
| 过去 3 个月        | 39.12%  | 1.63% | 41.23%  | 1.12% | -2.11% | 0.51% |
| 过去 6 个月        | 40.32%  | 1.48% | 47.04%  | 1.07% | -6.72% | 0.41% |
| 过去 1 年         | 131.41% | 1.44% | 97.60%  | 1.09% | 33.81% | 0.35% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 130.25% | 1.27% | 109.17% | 1.04% | 21.08% | 0.23% |

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动的比较

海富通股票基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005 年 7 月 29 日至 2006 年 12 月 31 日)



注：

1、按基金合同规定, 本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期, 截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定, 即股票资产 70%-95%, 一年期以内的国家债券和现金的比例不低于 5%。同时满足第 14 章 (七) 有关投资组合限制的各项比例要求。

2、自 2006 年 9 月起, 陈洪先生不再担任本基金基金经理, 2007 年 2 月起, 增聘蒋征先生为本基金基金经理。

## 第十三节 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拥有的各类有价值证券、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，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、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

# 第十四节 基金资产的估值

## （一）估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

## （二）估值日

本基金合同生效后，每工作日对基金财产进行估值。

## （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、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) 上市流通证券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：



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；

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) 权证：未上市的权证（主要指发行至上市日之间）及停牌，采用 B-S 模型计算其公允价值；已上市的权证的公允价值以其估值日该权证在证券交易所的收盘价计算；该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算。

5) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1)、2)、3)、4) 小项规定的方法对基金财产进行估值，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)、3)、4) 小项规定的方法对基金财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。

6) 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价计算得到的净价估值。

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财产进行估值，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财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。

### （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《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。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、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

### （七）基金份额净值的确认

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、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内（不含本数）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

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财产估值的准确性、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；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

#### 2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代理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。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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。

### 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿。本《基金合同》的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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，由此造成或扩大的损失有差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。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，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) 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财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律、行政法规、本《基金合同》或其他规定, 基金管理人或基金托管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, 则基金管理人或基金托管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。

#### 4、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, 列明所有当事人, 根据差错发生的原因确定差错责任方;

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人的交易数据的, 由基金注册登记人进行更正, 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计价错误达到基金份额净值 0.5% 时, 基金管理人应当公告, 并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 1 项中的第 4) 小项条款、第 2 项中的第 5) 小项条款进行估值时, 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, 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, 由此造成的基金财产估值错误, 基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十五节 基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

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。

## **(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) 收益分配原则**

- 1、基金收益分配采用现金红利或红利再投资方式。红利再投资指将现金红利按分红登记日经除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额。基金份额持有人可选择现金红利方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

- 2、每一基金份额享有同等分配权；

- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

- 4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多六次；

- 7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成。成立不满三个月，收益可不分配；

- 8、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

- 9、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，基金管理人应在二日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

## **(五) 基金收益分配中发生的费用**

- 1、收益分配采用红利再投资方式的，免收再投资的费用；采用现金红利方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在相关公告中规定。

- 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，注册登记人

可自动将该基金份额持有人的现金红利按权益登记日经除权后的基金份额净值为计算基准转为基金份额。

## 第十六节 基金的费用和税收

### （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、基金的证券交易费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后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五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五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 7 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，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财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### （四）基金管理费、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、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十七节 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、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）基金年度审计

1. 本基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金财务报表进行审计。

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按《基金合同》的规定进行公告。

# 第十八节 基金的信息披露

## （一）披露原则

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，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

## （二）基金募集信息披露

1、基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

2、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、基金管理人应当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。

4、基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，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十五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。

### （三）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单独编制，由基金托管人复核。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。基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在中国证监会指定的信息披露媒体公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值和基金份额净值。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，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六十日内，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十五个工作日内，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。

基金合同生效不足两个月的，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。

### （四）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。

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、提前终止基金合同；
- 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、变更基金代销机构；
- 20、更换基金注册登记人；
- 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、基金份额上市交易；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### **(五) 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。

#### (六) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,投资人可免费查阅。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,投资人可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金资产净值公告等公告文本的存放地点:上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼基金管理人办公地址;查阅方式:投资者可于营业时间查阅,或登录基金管理人网站查阅。

## 第十九节 风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合的风险、投资的合规性风险以及其他风险。

### (一) 投资组合的风险

投资组合的风险主要包括系统性风险、非系统性风险、以及流动性风险。

#### 1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动,从而导致基金收益水平变化,使本基金资产面临的风险。主要包括:

1) 政策风险:货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动,影响基金收益而产生风险;

2) 经济周期风险:经济运行具有周期性的特点,证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响,也呈现周期性变化,基金投资于债券与上市公司的股票,收益水平也会随之发生变化,从而产生风险;

3) 利率风险:金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券,收益水平会受到利率变化的影响,从而产生风险;

4) 购买力风险:基金份额持有人的收益将主要通过现金形式来分配,如果发

生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

## 2、非系统性风险

本基金的非系统性风险主要来源于持股的过度集中以及个股的选择风险。主要包括：

### 1) 持股的过于集中

本基金“景气行业”的股票组合构建方法容易造成对某一行业或企业持仓过于集中的情况，一旦判断错误，对基金组合的整体收益的影响会很大。

### 2) 个股的选择风险

本基金对于股票风险程度的界定，将沿用精选股票的理念，具体来说，单一的股价波动率不再被简单地作为所有股票的风险量化标准。股价的实质风险是体现在对企业未来盈利的可预测性上。如果企业的未来盈利具有较高的可预测性，那末其股价的内在风险就低，反之亦然。由于属于不同成长类别的企业未来盈利可预测程度存在着较大的差异性，其股票的内在风险也将呈现出不同的特性。

## 3、流动性风险

流动性风险是指基金所持证券资产变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资者的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合中个别投资品种持仓过大带来的变现困难。主要包括：

### 1) 巨额赎回

本基金属于开放式基金，在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 2) 持股过于集中

本基金“景气行业”的股票组合构建方法容易造成对某一行业或企业持仓过于集中的情况，这也会带来一定的资产变现困难，加大了流动性风险。

## （二）投资的合规性风险

投资的合规性风险是指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

## （三）其他风险

其他风险主要是指由于技术故障、内控制度的缺陷以及不可抗力等对基金收益造成损失的风险。主要包括：

1、因技术因素而产生的风险

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

2、因内控因素而产生的风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷等造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、欺诈行为、交易错误等风险。

3、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力的出现将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

## 第二十节 基金合同的终止和清算

### （一） 基金的终止

有下列情形之一的，本基金的基金合同终止：

1. 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，基金管理人有权根据法律法规及本合同规定的程序，宣布本基金的基金合同终止，并报中国证监会批准。若中国证监会另有规定的，则按其规定办理；

2. 基金合同经基金份额持有人大会表决终止；

3. 因重大违法、违规行为，基金合同被中国证监会责令终止；

4. 基金管理人职责终止，在六个月内没有新的基金管理人承接的；

5. 基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
6. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
7. 法律法规或中国证监会允许的其他情况。

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进行清算。

## （二） 基金的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和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之日起三十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) 基金清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 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

基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 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，报中国证监会批准并公告。

#### 7、基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存十五年以上。

## 第二十一节 基金合同的内容摘要

### （一）基金份额持有人权利与义务

#### 1.1 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法要求赔偿；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 1.2 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

5) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 2.1 基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、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) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
- 5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，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、其它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，以及采取其它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对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 8) 自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 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；
- 11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- 12) 按照法律法规，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它证券所产生的权利；
- 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) 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;
- 16) 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;
- 17) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

## 2.2 基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金, 办理基金备案手续;
- 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) 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;
- 4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务;
- 5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;
- 6) 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, 对所管理的不同基金分别管理、分别记帐, 进行证券投资;
- 7) 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非法利益, 不得委托第三人运作基金财产;
- 8) 接受基金托管人依法进行的监督;
- 9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合基金合同等法律文件的规定, 按照有关规定计算并公告基金份额净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;
- 10) 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;
- 11) 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；

12) 按基金合同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；

13) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

17) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

18) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，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；

19) 组织并参加基金财产清算组，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、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托管人；

21) 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；

22) 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；

23) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

24) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损基金份额持有人的利益及资源分配；

25) 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实施其他法律行为；

26) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **3.1 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) 监督本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 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) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它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，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 3.2 基金托管人的义务

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3) 建立健全内部控制、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；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不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) 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) 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；
- 8) 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；
- 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

- 10) 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；
- 11) 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、赎回的价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 12) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；
- 13) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 14) 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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 15) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料，保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；
- 16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 17) 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；
- 18) 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；
- 19) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 20) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 21) 参加基金财产清算组，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和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 23) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
- 24) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- 25) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- 26) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

#### （四）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

##### 1. 召开事由

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1、修改或终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- 2、转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- 3、更换基金托管人；
- 4、更换基金管理人；
- 5、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；
- 6、本基金与其它基金的合并；
- 7、变更基金类别；
- 8、变更基金投资目标、范围或策略；
- 9、变更基金份额持有人大会程序；
- 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。

##### 2. 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人（该比例以提出提议之时提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

4、代表基金份额百分之十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，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报国务院证券监督管理机构备案。

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。

### 3. 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、权益登记日；

6、如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达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。

### 4. 会议的召开方式

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，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。

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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人已按基金合同规定公布了会议通知；

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不少于权益登记日基金总份额的 50%）；

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；

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。

## 5. 议事内容与程序

### 1、议事内容

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；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第二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。

## 6. 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三分之二以上通过。

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百分之五十以上通过。

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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

## 7. 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。

3) 如果会议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者基金份额持有人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。基金管理人、托管人经大会召集人提前十个工作日书面通知,但拒不派授权代表计票的,不影响表决计票效力。

## 8. 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照投资基金法有关规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起五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备案后 2 日内,由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### (五) 基金合同解除和终止的事由、程序

出现下列情况之一的,本基金合同终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止;
- 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、基金托管人承接的;
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止,应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

## （六）争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、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或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，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，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、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。

## （七）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。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，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

# 第二十二节 基金托管协议的内容摘要

## （一）托管协议当事人

### 1.1 基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼

法定代表人：邵国有

注册资本：1.5 亿元人民币

经营范围：基金管理业务；发起设立及销售基金；及中国证监会批准的其他业务。

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

### 1.2 基金托管人

名称： 中国银行股份有限公司

住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人： 肖钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元

存续期间：持续经营

## **(二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查**

### **2.1 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查**

根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》《基金合同》和有关证券法规的规定，托管人应对基金管理人就基金财产的投资对象、基金财产的投资组合比例、基金财产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

1、基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反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。

2、基金托管人发现基金管理人的指令违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，可以拒绝执行，并通知基金管理人，向中国证监会报告。

3、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，并及时向中国证监会报告。

4、如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金

管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

## 2.2 基金管理人基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否将基金财产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

1、基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

2.3 基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

## （三）基金财产的保管

### 3.1 基金资产保管的原则

1、基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金财产。

2、基金托管人应当设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

3、基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

4、除依据《基金法》、《运作办法》、本《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益。基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于该基金财产；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，不得将固有资产与基金财产进行交易，或将不同基金财产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任。

5、基金托管人必须将基金财产与自有资产严格分开，将基金财产与其托管的其他基金财产严格分开；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的账簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

6、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产；

7、基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

### **3.2 基金合同生效时募集资金的验证和入账**

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集后，由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并分别出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金

银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### 3.3 基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

### 3.4 基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金、结算互保基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。

4、基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理，而限于上述关于账户开设、使用的规定。

5、在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

### 3.5 国债托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国银监会进行报备。

### 3.6 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库,但要与非本基金的其他实物证券分开保管;也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

### 3.7 与基金资产有关的重大合同的保管

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托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。若上述合同只有一份正本,先由基金管理人取得,则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。

## (四) 基金资产净值计算与复核

### 4.1 基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每工作日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的该基金份额净值,并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人;如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异,且双方经协商未能达成一致,基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布,基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 4.2 基金账册的建账和对账

1、基金管理人和基金托管人在本基金《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方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。

2、双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

## 4.3 基金财务报表与报告的编制和复核

1、基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了之日起 5 日内完成；招募说明书在本基金《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满之日起 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起十五个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

2、基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

3、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，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公



章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，应当根据有关法律法规的规定妥善保管之。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的，基金管理人（注册登记人）应当提供任何必要的协助。

### **（六）争议解决方式**

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议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。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。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》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

### **（七）托管协议的修改与终止**

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。修改后的新协议，报中国证监会核准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金或《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十三节 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) 资料寄送服务

#### 1. 帐户确认书

根据客户的需要,为客户寄送开放式基金帐户确认书。如客户需要开放式基金帐户的主帐户卡,根据中国证券登记结算公司的业务规则到它指定的券商营业网点打印。

#### 2. 对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。

季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的持有人寄送,年度对账单在每年度结束后 15 个工作日内对所有持有人寄送。

对帐单的寄送方式分为邮寄和电子邮件两种方式。如客户需要重置寄送方式或寄送频率,请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

#### 3. 其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### (二) 基金间转换服务

投资人可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额,并享受基金间的转换费率。

### (三) 定期投资计划

在技术条件成熟时,基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划,投资人可以通过固定的渠道,定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另行公告。

### (四) 网络在线服务

通过基金公司网站的留言板和客服信箱,客户可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

我们为现有投资人提供了基金帐户查询、交易明细查询、对帐单寄送方式或

频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

### （五）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金客户提供通过基金管理公司网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理公司通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

### （六）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询，在正常交易时间提供针对直销客户的电话委托下单服务。

呼叫中心人工座席每个交易日上午 9：00—11：30，下午 13：00—17：30 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

每个周五下午 15：30—17：30，基金经理或投资顾问定期通过呼叫中心与投资人进行交流，就投资人关心的基金投资运作情况、市场走势、宏观经济等问题进行解答。

客服电话：021-38784858；

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

### （七）投诉受理

投资人可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金公司和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复，对于不能及时回复的投诉，我们承诺在两个工作日之内对您的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，我们将在顺延的工作日当日进行回复。

### （八）网上开户与交易服务

2005 年 10 月 28 日，海富通基金管理有限公司与银联电子支付服务有限公司

合作正式推出网上交易平台，为投资者提供方便快捷的网上在线开户交易服务，中国银联客户可以通过海富通基金网站实现网上开户和交易。（包括认购、申购、赎回等）。

目前，对持有建设银行龙卡、兴业银行兴业卡或其他银联联网银行卡的投资者通过本公司网上交易系统认购、申购本公司旗下开放式基金实行费率优惠，具体优惠政策如下：

（一）对于持有建设银行龙卡的投资者：

- 1、投资者通过本公司网上交易平台申购海富通精选（基金代码：519011）、海富通收益（基金代码：519003）、海富通股票（基金代码：519005）、海富通回报（基金代码：519007）和海富通优势（基金代码：519013），统一按照上述基金公告费率的 5 折收取。
- 2、投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额（A 级基金代码：519505，B 级基金代码：519506）转换为海富通精选、海富通收益、海富通股票、海富通回报和海富通优势基金的，转换费统一按海富通精选、海富通收益、海富通股票、海富通回报和海富通优势基金申购费率的 5 折计算。

（二）对于持有兴业银行兴业卡或其他银联联网银行卡的投资者：

1. 投资者通过本公司网上交易平台申购海富通精选、海富通收益、海富通股票、海富通回报和海富通优势基金，公司将不以申购金额分档，统一按 0.6% 的费率收取申购费。
2. 投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额转换为海富通精选、海富通收益、海富通股票、海富通回报和海富通优势基金份额的，转换费统一按 0.6% 的费率计算。

## 第二十四节 其他披露事项

（一）基金注册登记人

1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的注册登记业务。基金管

理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、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，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

注册登记人的更换程序：

(1) 提名：由基金管理人提名。

(2) 核准：新任注册登记人报中国证监会审查资格并核准后，原任注册登记人方可退任；

(3) 公告：基金注册登记人更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(4) 交接：原基金注册登记人应做出处理基金注册登记事务的报告，并与新任基金注册登记人完成业务移交手续，向新任基金注册登记人提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记人与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金注册登记人仍有义务保留本基金正式移交日之前的注册登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金注册登记人处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记人业务移交产生的问题，原基金注册登记人仍有协助解决之义务。

**2. 基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记业务。**

### **3. 基金注册登记人概况**

基金注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：陈耀先

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海

证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## 第二十五节 基金管理人和基金托管人的更换

### (一) 基金管理人和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：

- 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) 法律法规规定的其他情形。

基金管理人职责终止时，应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，选任新的基金管理人；新基金管理人产生前由中国证监会指定临时基金管理人。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 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) 法律法规规定的其他情形。

基金托管人职责终止时,应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会,选任新的基金托管人;新基金托管人产生前由中国证监会指定临时基金托管人。

## **(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决议。

3) 核准并公告:上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内,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二日内在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

4) 交接: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。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

5) 审计并公告: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**

1) 提名:新任基金托管人由基金管理人或代表 10%或以上基金份额的基金份额持有人提名,新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会或银行业监督管理机构规定的资格条件;

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新任基金托管人形成决议;

3) 批准:相关基金份额持有人大会决议经中国证监会核准,新任的基金托管人方可继任;新任的基金托管人产生前,由中国证监会指定临时基金托管人;原基金托管人须经中国证监会批准后方可退任;

4) 审计:基金托管人职责终止的,应当按照法律法规规定聘请会计师事务所

对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案。

5) 接交：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金托管业务资料，及时办理基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收；

6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会和银行业监督管理机构批准后 5 个工作日内公告，并在公告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。

## 第二十六节 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。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，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 第二十七节 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- (一) 中国证监会批准海富通股票证券投资基金设立的文件
- (二) 《海富通股票证券投资基金基金合同》
- (三) 《海富通股票证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 海富通基金管理有限公司募集设立海富通股票证券投资基金的法律意见书
- (七) 《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》