

# 华夏平稳增长混合型证券投资基金 招募说明书（更新）

2007 年第 1 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

## 重要提示

华夏平稳增长混合型证券投资基金由兴业证券投资基金转型而成。依据中国证监会2006年7月25日证监基金字[2006] 144号文核准的兴业证券投资基金基金份额持有人大会决议，兴业证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“华夏平稳增长混合型证券投资基金”。自2006年8月9日起，由《兴业证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》生效。

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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本招募说明书所载内容截止日为2007年2月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2006年12月31日（财务数据未经审计）。

## 目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	4
四、基金托管人.....	11
五、相关服务机构.....	14
六、基金的历史沿革.....	25
七、基金的存续.....	25
八、基金的份额激励安排.....	26
九、基金份额的申购与赎回.....	26
十、基金的转托管与非交易过户等其他业务.....	33
十一、基金的投资.....	33
十二、基金的业绩.....	41
十三、基金的财产.....	41
十四、基金资产的估值.....	42
十五、基金的收益与分配.....	44
十六、基金的费用与税收.....	45
十七、基金的会计与审计.....	47
十八、基金的信息披露.....	48
十九、风险揭示.....	50
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	52
二十一、基金合同的内容摘要.....	53
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	62
二十二、对基金份额持有人的服务.....	69
二十三、其他应披露事项.....	70
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	72
二十五、备查文件.....	72

## 一、绪言

《华夏平稳增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定以及《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金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。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同的当事人应按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

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：

- 基金或本基金：指华夏平稳增长混合型证券投资基金，本基金由兴业证券投资基金转型而成；
- 基金兴业：指兴业证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
- 基金合同：指《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》及其不时做出的任何有效修订和补充，本基金合同由《兴业证券投资基金基金合同》修订而成；
- 托管协议：指《华夏平稳增长混合型证券投资基金托管协议》及其不时做出的任何有效修订和补充，本托管协议由《兴业证券投资基金托管协议》修订而成；

- 招募说明书：指本《华夏平稳增长混合型证券投资基金招募说明书》及基金管理人对其定期做出的更新；
- 集中申购公告：指《华夏平稳增长混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及其不时做出的修订；
- 《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及其不时做出的修订；
- 《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订；
- 《业务规则》：指 2005 年 7 月 14 日上海证券交易所发布并施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则(试行)》及其不时做出的修订；
- 基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享有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：指华夏基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国农业银行；
- 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》的规定，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；
- 基金转型：指对包括基金兴业由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“华夏平稳增长混合型证券投资基金”等一系列事项的统称；
- 本基金合同生效日：指本《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》生效起始日，本基金合同自兴业证券投资基金终止上市之日起生效，原《兴业证券投资基金基金合同》自同一日起失效；
- 集中申购期：指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过 1 个月；

- 申购：指投资者按基金合同规定的条件，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基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
- 基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的某一基金(包括本基金)的基金份额转为基金管理人管理的、由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金(包括本基金)的基金份额的行为；
- 基金销售：指对基金申购、赎回、转换等业务的统称；
- 场内销售：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理的基金销售业务；
- 场外销售：指不通过上海证券交易所开放式基金销售系统，而通过各销售机构柜台系统办理的基金销售业务；
- 直销机构：指基金管理人，即华夏基金管理有限公司；
- 代销机构：指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的机构，其中可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位；
- 销售机构：指基金管理人及代销机构；
- 登记结算业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括持有人基金账户管理、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；
- 登记结算机构：指办理本基金登记结算业务的机构，本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司；
- 上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股账户(简称“A股账户”)或证券投资基金账户(简称“基金账户”)，投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理申购、赎回等业务时需持有上海证券账户；
- 开放式基金账户：指投资者以上海证券账户为基础、在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，投资者办理场外申购、赎回等业务时需具有开放式基金账户；
- 指定交易：指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定

- 交易”;
- 基金存续期: 指自《兴业证券投资基金基金合同》生效之日起至本《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限;
- 工作日: 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
- 开放日: 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日;
- 日/月: 指公历日/月;
- T日: 指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的日期;
- T+n日: 指T日后(不包括T日)第n个工作日, n指自然数;
- 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;
- 基金资产总值: 指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款及其他资产的价值总和;
- 基金资产净值: 指基金资产总值减去负债后的价值;
- 基金份额净值: 指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数;
- 基金资产估值: 指计算、评估基金资产和负债的价值, 以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
- 指定媒体: 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站;
- 法律法规: 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
- 不可抗力: 指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素, 包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、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、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

联系人：张弘毅

联系电话：(010)88066688

传真：(010)88066566

华夏基金管理有限公司注册资本为 13800 万元，公司股权结构如下：

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	40.725%
西南证券有限责任公司	35.725%
北京证券有限责任公司	20%
中国科技证券有限责任公司	3.55%
合计	100%

## (二)主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

凌新源先生：董事长，硕士。现兼任北京证券有限责任公司董事长，曾任华夏证券股份有限公司副总裁、中国钢铁工贸集团公司总裁助理、中国冶金进出口总公司总裁助理、北京国际信托投资公司业务部副经理。

范勇宏先生：副董事长、总经理，博士。曾任华夏证券股份有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王东明先生：董事，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限责任公司董事长、中信基金管理有限责任公司董事长、中国国际信托投资公司董事、协理，中信控股有限责任公司董事、中信国际金融控股有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事，北京华远经济建设公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司部门副经理，南方证券公司副总裁，华夏证券公司发行部副总经理等职务。

范剑先生：董事，硕士。现任西南证券有限责任公司副总裁。曾任中国煤炭工业进出口集团公司市场部副总经理。

李洋先生：董事，学士。现任北京证券有限责任公司资产保全部总经理。曾任北京市财政局外事

财务处处长。

王邦志先生：董事，硕士。现任中国科技证券有限责任公司副总经理。曾任中国科技国际信托投资有限责任公司副总经理、信贷部项目经理、证券总部总经理。

王连洲先生：独立董事，学士。现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制造币局工作。

龙涛先生：独立董事，硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计纽约分部从事审计和财务分析工作。

涂建先生：独立董事，学士。现任中国国际贸易促进委员会资产监督管理委员会资产管理中心主任，并兼任深圳证券交易所上市公司专家委员会委员。

鲁明泓先生：独立董事，博士。现任南京大学商学院教授、博士生导师、哥伦比亚大学客座研究员。曾在美国哈佛大学做博士后研究工作。

刘芳勤女士：独立董事，学士，高级经济师。现已退休。曾任中国工商银行北京朝阳支行副行长、吉林省长春市计划委员会副处长。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理、工会主席和机构理财部总经理等。

方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生：监事，硕士。现任西南证券有限责任公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生：监事，学士，中国注册会计师协会非执业会员。现任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监。曾任华夏证券股份有限公司并购业务管理部常务副总经理、计划财务部副总经理、投资银行总部副总经理，中华会计师事务所注册会计师。

瞿颖女士：监事，硕士，中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部业务主管。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

## 2、本基金基金经理

张龙先生，英国南安普顿大学经济学硕士。曾任职于长江证券公司研究所、长盛基金管理公司研究部。2001年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、数量分析研究员、兴业证券投资基金基金经理（2004年9月至2006年8月）、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理（2006年8月起任职）。

张益驰先生，理学硕士。曾任平安证券有限公司研究所研究员。2002年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、兴科证券投资基金基金经理(2004年9月至2006年2月期间)、兴安证券投资基金基金经理（2005年8月至2006年2月期间）、兴华证券投资基金基金经理（2006年2月至2007年2月期间）。现

任华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理（2006年8月起任职）、华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理（2006年11月起任职）。

### 3、本公司投资决策委员会成员

范勇宏先生：华夏基金管理有限公司副董事长、总经理。

滕天鸣先生：华夏基金管理有限公司执行副总经理。

王亚伟先生：华夏基金管理有限公司总经理助理，华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

刘文动先生：华夏基金管理有限公司投资总监，兴安证券投资基金基金经理、兴华证券投资基金基金经理。

杨爱斌先生：华夏基金管理有限公司固定收益总监。

石波先生：华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部执行副总经理，华夏回报证券投资基金及华夏回报二号证券投资基金基金经理。

程海泳先生：华夏基金管理有限公司基金经理。

张益驰先生：华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理。

韩会永：华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理，华夏债券投资基金基金经理，华夏现金增利证券投资基金基金经理。

唐俊：华夏基金管理有限公司基金经理。

乔巍：华夏基金管理有限公司基金经理。

### 4、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、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### (四)基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8)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。

4、本基金管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

- (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)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行为。

#### 5、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利益；
- (2)不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、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。

#### (五)基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、操作控制、信息沟通、内部稽核等要素。

##### 1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1)公司建立了科学的公司治理结构,在业界最早引入了独立董事制度,目前有独立董事5名。董事会下设资格审查委员会、薪酬委员会、审计委员会等专业委员会,其中审计委员会负责评价与完善公司内部控制体系。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构。

(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的职业道德的培养,制定和颁布了《职业操守》及《职业道德操守实务指引》,并进行持续教育。

##### 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的不利因素(即风险)进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

##### 3、操作控制

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相互制约。

##### (1)投资控制制度

①投资决策与执行相分离。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例,在债券基金投资方面,投资决策委员会负责制订基金投资组合的久期和类属配置政策,基金经理在投资决策委员会确定的范围内,负责确定与实施投资策略、进行具体的证券选择、构建和调整投资组合并下达投资指令,中央交易室交易员负责交易执行。

②投资决策权限控制。基金经理对单只证券投资超过一定比例的,须提交书面报告,经投资总

监或投资决策委员会(视投资比例而定)批准后才能执行。

③警示性控制。中央交易室对有问题的交易指令进行预警,并在投资组合中各类资产的投资比例将达到法规和公司规定的比例限制时进行预警。有问题的交易指令包括有操纵股价嫌疑、有与市场特定价位委托单大量对倒嫌疑的交易指令等,中央交易室发现该类指令时,向投资总监和监察稽核部门及时提出警示,基金经理须及时向投资总监和监察稽核部门说明情况,投资总监和监察稽核部门判断是否违规及是否停止交易。对投资比例的预警是通过交易系统设置各类资产投资比例的预警线,在达到接近限制比例前的某一数值时,系统自动预警,中央交易室及时向基金经理反馈预警情况。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司规定的禁止行为,制定证券投资限制表,包括受限制的证券和受限制的行为(如反向交易、对敲和单只证券投资的一定比例等)。基金经理构建组合时不能突破这些限制,同时中央交易室对此进行监控,通过预先的设定,交易系统能对这些情况进行自动提示和限制。

⑤一致性控制。对基金经理下达的投资交易指令、交易员输入交易系统的交易指令和基金会计成交回报进行一致性复核,确保交易指令得到准确执行。

⑥多重监控和反馈。中央交易室对投资行为进行一线监控(包括上述警示性控制和禁止性控制)。中央交易室本身同时受投资总监、基金经理及监察稽核的三重监控:投资总监监控交易指令的正确执行和交易室监控职能的有效发挥;基金经理监控交易指令的正确执行;监察稽核部门监控有问题的交易。

## (2)会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程,确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

## (3)技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

## (4)人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。

#### (5) 监察制度

公司设立了独立的法律监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

#### 4、信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司所有业务均已做到了办公自动化，不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

#### 5、内部稽核

公司设立了独立于各业务部门的稽核部，内部稽核人员定期检查和评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况并提出相应的修改意见。

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

### 四、基金托管人

#### (一) 基金托管人基本情况

名称：中国农业银行

住所：北京市海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：杨明生

成立时间：1979 年 2 月 23 日

组织形式：全民所有制

注册资金：361 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

联系电话：(010)68424199

传真：(010)68424181

联系人：李芳菲

## (二)基金托管业务经营情况

截止 2006 年 12 月 31 日, 中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 48 只, 基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长二号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金, 托管基金份额达 892.29 亿份。

## (三)主要人员情况

杨明生先生: 中国农业银行党委书记、行长。硕士、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任, 农行沈阳市分行副行长、党组成员, 农行工业信贷部主任助理、副主任、主任, 农行天津市分行副行长、党组副书记(主持工作), 农行天津市分行行长、党组书记, 农行副行长、党委副书记。现任农行党委书记、行长。

杨琨先生: 中国农业银行副行长。硕士、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长, 农行人事教育部副主任, 农行市场开发部总经理, 农行安徽省分行行长、党委书记, 中国农业银行行长助理。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生: 托管业务部总经理。博士, 高级经济师, 曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理, 农行总行法律事务部副总经理、总经理。现任托管业务部总经理。

刘树军先生: 托管业务部副总经理。工商管理硕士, 高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书, 农行总行信贷部工业信贷处处长。现任托管业务部副总经理。

余晓晨先生: 托管业务部副总经理。经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长, 现任托管业务部副总理。

理。

#### (四)基金托管部门的设置及员工情况

1998年5月，中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统，现有员工79名。

#### (五)基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

基金托管人内部风险控制的目标是加强内部管理，防范经营风险，保证托管业务部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行。内部控制的对象有：

- (1)托管业务部业务规章和各处业务处理办法；
- (2)托管业务部各处职责设置和处内岗位职责设置；
- (3)托管业务部业务流程和处内操作规程；
- (4)员工职业道德的遵守；
- (5)其它控制事项。

##### 2、内部控制组织结构

基金托管人在托管业务部设立风险管理处作为专门的内部风险控制部门，独立、客观、公正地进行内部风险控制业务，不受各处和个人干涉。风险管理处内部控制的检查评价结果将作为各处改进工作的依据。

##### 3、内部控制制度及措施

在内容上，基金托管人的内部风险控制分健全性检查和符合性检查。健全性检查是对托管业务部和各处制定的业务规章、办法的健全性进行检查。符合性检查是指对托管业务部各处在本处范围内的分工和对员工操作权限的授权是否符合法律、法规和业务规章的规定进行检查，检查工作具体分为四个阶段：即准备阶段、实施阶段、报告阶段、追踪阶段。

(1)准备阶段。成立检查小组，掌握被查部门的基本情况，收集有关资料，通知被检查单位。

(2)实施阶段。根据检查内容，采取适当方式检查有关证据，询问有关人员，或进行操作试验并做好记录。

(3)报告阶段。撰写评价报告，与被检查单位交换意见后，报总经理批准，并将批准后的结论和意见送达被检查单位。被检查单位有权要求复查。

(4)追踪阶段。对检查结论和意见的执行情况进行跟踪检查，督促落实。

#### 4、其他事项

最近一年内，基金托管人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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过核查基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 五、相关服务机构

#### (一) 销售机构

##### 1、直销机构：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

电话：(010)88066688

传真：(010)88066508

联系人：吴志军

##### 2、场外代销机构：

###### (1) 中国农业银行

住所：北京市海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：杨明生

客户服务电话：95599

传真：（010）68424199

联系人：李芳菲

（2）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号 招商银行大厦

法定代表人：秦晓

客户服务电话：95555

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：朱虹，刘薇

（3）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

传真：（010）66275654

联系人：王琳

（4）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：蒋超良

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：曹榕

（5）中国银河证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：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）66568613、66568587

传真：（010）66568536

联系人：郭京华

（6）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：（021）62580818

传真：（021）62583439

联系人：韩星宇

（7）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：王明权

电话：（021）54033888

传真：（021）54030294

联系人：李清怡

（8）广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：（020）87555888

传真：（020）87557985

联系人：肖中梅

（9）中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）84588266

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

（10）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：400-8888-108

传真：（010）65182261

联系人：权唐

（11）光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 室

法定代表人：王明权

电话：（021）68823685

传真：（021）68815009

联系人：刘晨

（12）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）82943511

传真：（0755）82943237

热线：4008881111；（0755）26951111

联系人：黄健

（13）联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：（0755）82493561

传真：（0755）82492062

联系人：盛宗凌

（14）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：（021）53594566

传真：（021）53858549

联系人：金芸、杨薇

（15）国信证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 楼

法定代表人：何如

联系电话：（0755）82133066

传真：（0755）82133302

联系人：林建闽

（16）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：（021）68419974

传真：（021）68419867

联系人：杨盛芳

（17）长江证券有限责任公司

住所：湖北省武汉市江汉区新华下路特 8 号

办公地址：上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F

法定代表人：明云成

电话：（027）65799560

传真：（027）85481532

联系人：毕艇

（18）华泰证券有限责任公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：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）84457777-721/950、84579897

传真：（025）84579879

联系人：袁红彬、李金龙

（19）华西证券有限责任公司

住所：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）

法人代表：张慎修

电话：（0755）83025430

传真：（0755）83025991

联系人：杨玲

（20）东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街 138—1 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李树

电话：（0431）96688-99、5096733

传真：（0431）5680032

联系人：高新宇

（21）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市东海路 28 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：（0532）5023457

传真：（0532）5022025

联系人：丁韶燕

（22）信泰证券有限责任公司

住所：南京市长江路 88 号

办公地址：南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

电话：（025）84784765

传真：（025）84784830

联系人：舒萌菲

（23）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李炜

电话：（0531）2024184

传真：（0531）2024197

联系人：付英梅

（24）国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

办公地址：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

电话：（010）64482828-390

传真：（010）64482090

联系人：马泽承

（25）中信金通证券有限责任公司

住所：杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9-12 楼

办公地址：杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9-12 楼

法定代表人：应土歌

电话：（0571）85783737

传真：（0571）85783748

联系人：余少南

（26）金元证券有限责任公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：郑辉

电话：（0755）83025666

传真：（0755）83025625

联系人：金春

（27）中原证券股份有限公司

住所：许昌市南关大街 38 号

办公地址：郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 11 楼

法定代表人：张建刚

电话：（0371）967218、（0371）65585256

传真：（0371）65585670

联系人：巴冠华

（28）南京证券有限责任公司

住所：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

办公地址：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

电话：（025）83364032

传真：（025）83364032

联系人：石健

（29）山西证券有限责任公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心

办公地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心

法定代表人：吴晋安

电话：（0351）8686766、8686708

传真：（0351）8686709

联系人：张治国

（30）东吴证券有限责任公司

住所：江苏省苏州市十梓街 298 号

办公地址：苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

联系人：方晓丹

（31）西南证券有限责任公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

法定代表人：蒋辉

电话：（023）63786397

传真：（023）63786312

联系人：杨卓颖

（32）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：段强

电话：（0755）83199511

传真：（0755）83199545

联系人：刘军辉

（33）平安证券有限责任公司

住所：深圳市八卦三路平安大厦三楼

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法人代表：叶黎成

电话：（0755）82450826 、22622287

传真：（0755）824332794

联系人：余江、庄维佳

（34）国海证券有限责任公司

住所：中国广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址：中国广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：（0771）5539262

传真：（0771）5539033

联系人：覃清芳

（35）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5 楼

法定代表人：陈学荣

电话：（021）68865020

传真：（021）68865938

联系人：陈伟

（36）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：平岳

电话：（021）68604866

传真：（021）50372474

联系人：张静

（37）国联证券有限责任公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：范炎

电话：（0510）82831662、82588168

传真：（0510）82831589

联系人：袁丽萍

（38）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

电话：（0755）25832686

传真：（0755）25831718

联系人：杨柳

（39）渤海证券有限责任公司

住所：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

电话：（022）28451883

传真：（022）28451616

联系人：徐焕强

（40）广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼六楼

法定代表人：吴张

电话：（020）87320991

传真：（020）87325036

联系人：江欣

(41)国元证券有限责任公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

传真：（0551）2634400-1171

联系人：李蔡

(42) 东莞证券有限责任公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：周建辉

电话：961130

传真：(0769) 22119423

联系人：童怡腾

### 3、场内代销机构

投资者可以通过具有“上证基金通”基金业务资格的证券公司办理申购业务。

4、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

### (二)登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

法定代表人：陈耀先

联系人：朱立元

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

### (三)律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 11 层

法定代表人：王立华

联系电话：(010)88092188

传真：(010)88092150

联系人：杨科

经办律师：吴冠雄 杨科

#### (四)会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：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

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 61238888

传真：(021) 61238800

联系人：许康玮

经办注册会计师：汪棣、许康玮

## 六、基金的历史沿革

华夏平稳增长混合型证券投资基金由兴业证券投资基金转型而成。

自 2006 年 8 月 9 日基金兴业终止上市之日起，原《兴业证券投资基金基金合同》失效，《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“华夏平稳增长混合型证券投资基金”。

## 七、基金的存续

### (一)基金份额的变更登记

基金份额的变更登记是指基金兴业终止上市后，基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司上海分公司取得终止上市权益登记日基金份额持有人名册，并进行基金份额更名以及必要的信息变更之后，中国证券登记结算有限责任公司根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

### (二)基金类型和存续期限

1、基金的类别：混合型基金。

2、基金的运作方式：契约型开放式。

3、基金存续期限：不定期。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，如连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金财产净值低于5,000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

## 八、基金的份额激励安排

对于原基金兴业份额持有人，为鼓励其长期持有，基金管理人承诺以自有资金提供份额激励，具体安排如下。

1、激励对象：限于持有由原基金兴业份额转型而来的基金份额（代码为“519028”）的投资者。

2、激励安排：

(1)在基金开放日常申购、赎回满6个月之日(如该日为节假日，则顺延至最近一个开放日)，登记结算机构将根据各个持有人持有的原基金兴业份额数量，按1%的比例增加其基金份额(新增份额不计入下次激励计算基数，按四舍五入保留至整数位)，同时扣减基金管理人持有的基金份额；

(2)在基金开放日常申购、赎回满1年之日(如该日为节假日，则顺延至最近一个开放日)，登记结算机构将根据各个持有人持有的原基金兴业份额数量，按0.5%的比例增加其基金份额(按四舍五入保留至整数位)，同时扣减基金管理人持有的基金份额；

(3)份额激励基数的计算方法为该基金代码(519028)下投资者期末基金份额扣除期间分红再投资份额(若有)后，根据期间基金累计分红比例调整所得的数额。

## 九、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回场所

1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京、上海、深圳、广州的投资理财中心以及网上交易平台。

(1) 北京金融街投资理财中心

地址：北京西城区金融街33号通泰大厦B座1层(100032)

电话：(010) 88087226/7/8

传真：(010) 88087225

(2) 北京海淀投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村南大街11号光大国际大厦一层(100081)

电话：(010) 68458998/68458698/68458718/68468598

传真：（010）68458598

（3）北京朝阳投资理财中心

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO B 座 0104（100022）

电话：（010）58693528/16/26

传真：（010）58693508

（4）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街 29 号东环广场 B 座一层（100027）

电话：（010）64185181/82/83

传真：（010）64185180

（5）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路 9 号（新科祥园小区大门口一层）（100080）

电话：（010）82523197/98/99

传真：（010）82523196

（6）北京崇文投资理财中心

地址：北京崇文区安化寺幸福家园一层（100062）

电话：（010）67146300/400

传真：（010）67133146

（7）上海投资理财中心

地址：上海市陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 3002-3003 室（200120）

电话：（021）58772855/77/99

传真：（021）58772008

（8）深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 108 室（518026）

电话：（0755）82033033

传真：（0755）82031949

（9）广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区天河北路 569 号芳草园首层（510630）

电话：（020）38460001

传真：（020）38461077

（10）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址: [www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)

## 2、场外代销机构

	销售机构名称	网址	客户服务电话
1	中国农业银行	<a href="http://www.abchina.com">www.abchina.com</a>	95599
2	招商银行股份有限公司	<a href="http://www.cmbchina.com">www.cmbchina.com</a>	95555
3	中国建设银行股份有限公司	<a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>	95533
4	交通银行股份有限公司	<a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>	95559
5	中国银河证券有限责任公司	<a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>	800-820-1868
6	国泰君安证券股份有限公司	<a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>	021-962588、400-8888-666
7	申银万国证券股份有限公司	<a href="http://www.sw2000.com.cn">www.sw2000.com.cn</a>	021-962505
8	广发证券股份有限公司	<a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>	020-87555888-875
9	中信证券股份有限公司	<a href="http://www.ecitic.com">www.ecitic.com</a>	各地营业部咨询电话
10	中信建投证券有限责任公司	<a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>	400-8888-108
11	光大证券股份有限公司	<a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>	各地营业部咨询电话
12	招商证券股份有限公司	<a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>	400-8888-111、0755-26951111
13	联合证券有限责任公司	<a href="http://www.lhzq.com">www.lhzq.com</a>	400-8888-555
14	海通证券股份有限公司	<a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>	021-962503
15	国信证券有限责任公司	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>	800-810-8868
16	兴业证券股份有限公司	<a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>	021-68419974
17	长江证券有限责任公司	<a href="http://www.cz318.com.cn">www.cz318.com.cn</a>	400-8888-999、027-65799999
18	华泰证券有限责任公司	<a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a>	400-8888-168、025-84579897
19	华西证券有限责任公司	<a href="http://www.hx168.com.cn">www.hx168.com.cn</a>	4008-888-818
20	东北证券有限责任公司	<a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a>	0431-96688-99、0431-5096733
21	中信万通证券有限责任公司	<a href="http://www.zxwt.com.cn">www.zxwt.com.cn</a>	0532-5022026
22	信泰证券有限责任公司	<a href="http://www.thope.com">www.thope.com</a>	025-84784765
23	齐鲁证券有限公司	<a href="http://www.qlzq.com.cn">www.qlzq.com.cn</a>	0531-82084184
24	国都证券有限责任公司	<a href="http://www.guodu.com">www.guodu.com</a>	800-810-8809
25	金通证券股份有限公司	<a href="http://www.bigsun.com.cn">www.bigsun.com.cn</a>	0571-96598

26	金元证券有限责任公司	www.jyzq.cn	0755-83025695
27	中原证券股份有限公司	www.ccnew.com	0371-967218、0371-65585256
28	南京证券有限责任公司	www.njzq.com.cn	025-83364032
29	山西证券有限责任公司	www.i618.com.cn	0351-8686868
30	东吴证券有限责任公司	www.dwjq.com.cn	0512-96288
31	西南证券有限责任公司	www.swsc.com.cn	023-63786397
32	世纪证券有限责任公司	www.csc.com.cn	0755-83199511
33	平安证券有限责任公司	www.pa18.com	95511
34	国海证券有限责任公司	www.ghzq.com.cn	全国: 4008888100 广西: 96100
35	湘财证券有限责任公司	www.xcsc.com	021-68865020
36	中银国际证券有限责任公司	www.bocichina.com.cn	各地营业部咨询电话
37	国联证券有限责任公司	www.glsc.com.cn	0510-82588168
38	第一创业证券有限责任公司	www.fcsc.com.cn	0755-25832686
39	渤海证券有限责任公司	www.ewww.com.cn	022-28455588
40	广州证券有限责任公司	www.gzs.com.cn	020-87320991、87320595
41	国元证券有限责任公司	www.gyzq.com.cn	安徽地区: 96888; 全国: 400-8888-777
42	东莞证券有限责任公司	www.dgzq.com.cn	0769-961130、0769-22380828

### 3、场内代销机构

场内申购、赎回业务可通过具有“上证基金通”基金业务资格的证券公司办理。

投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回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。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

#### (二) 申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，场内申购、赎回业务的开放时间为9:30-11:30和13:00-15:00，场外申购、赎回业务的开放时间由基金管理人与销售机构约定。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

## 2、申购、赎回的开始时间

本基金已于2006年10月13日开始办理日常申购、赎回等业务。

### (三)申购和赎回的原则

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、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

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

4、投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所的相关业务规则。

5、本基金开放日常申购、赎回后一年以内，由原基金兴业份额变更登记而形成的基金份额代码为“519028”，投资者只可提交赎回申请，不得提交申购申请；通过集中申购、日常申购取得的基金份额代码为“519029”，投资者可提交申购、赎回申请。不同代码的基金份额净值相同。基金开放日常申购、赎回满一年以后，基金管理人可向上海证券交易所和登记结算机构申请撤销“519028”代码，在上海证券交易所同意，且登记结算机构办理完成份额变更登记后，原“519028”代码下的基金份额将使用“519029”代码。基金代码的变更对持有人利益无影响。

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

### (四)申购和赎回的数额限制

1、投资者办理场内申购时，每次申购金额不得低于1000元，超过部分需为100元的整数倍，最高不能超过99,999,900元；投资者办理场外申购时，每次申购金额不得低于1000元。投资者可以多次申购，累计申购金额不设上限。

2、投资者赎回份额不设限制。

3、基金管理人有权对以上数额限制进行调整，最迟应在调整生效前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

### (五)申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回申请的提出

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。投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

投资者应注意：在办理场内申购、赎回业务之前，需参照第八条第(五)款第2项的规定，开立上海

证券账户，并指定交易或转指定交易在可办理本基金场内申购、赎回业务的证券公司；在办理场外申购、赎回业务之前，需通过销售机构办理开放式基金账户的注册或注册确认手续。

## 2、申购和赎回申请的确认与通知

投资者T日申购基金成功后，登记结算机构在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T日赎回基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者办理扣减权益的登记手续。

T日规定时间受理的申购、赎回申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况。

基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。但基金管理人、登记结算机构最迟须于受理申购、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、申购和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，申购不成功的款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定划付赎回款项。赎回款项应在自受理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和本招募说明书的有关规定处理。

### (六)拒绝或暂停申购的情形

在发生下列情形时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购；
- 2、证券交易场所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害已有基金份额持有人的利益；

4、个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；

5、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

### (七)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在发生下列情形时,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请:

- 1、不可抗力导致基金无法支付赎回款项;
- 2、证券交易场所决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- 3、基金连续两个开放日以上发生巨额赎回;
- 4、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应当在当日向中国证监会备案,并及时公告。已接受的赎回申请,基金管理人在有能力兑付时,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受理赎回申请人的部分赎回申请,其余赎回申请则延期办理,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。赎回申请的延期办理最迟不得超过正常支付时间20个工作日。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。

在暂停赎回的情形消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### (八)巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

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

(2)部分延期赎回:当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难,或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金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,应当按单个持有人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下一个开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。

当发生巨额赎回并部分延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式,在3个交易日内通知基金份额持有人并说明有关处理方法,同时在至少一种指定媒体公告。

本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

#### (九)申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

暂停申购或暂停赎回结束、基金重新开放时，基金管理人应在至少一种指定媒体公告：

1、如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定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。

2、如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，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指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

#### (十)基金的转换

基金管理人可与销售机构协商，为投资者提供基金转换的服务，即投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。其中，基金转出视同赎回，需遵守转出基金有关赎回业务的各项规定，并缴纳赎回费用；基金转入视同申购，需遵守转入基金有关申购业务的各项规定。基金管理人或销售机构可以就基金转换业务收取一定的手续费。有关基金转换业务的具体规则由基金管理人制定并另行公告。

### 十、基金的转托管与非交易过户等其他业务

(一)投资者可将登记在上海证券账户内的基金份额，在上海证券交易所场内不同会员营业部之间办理转指定交易；也可以将基金份额在上海证券交易所场内系统和场外系统之间办理跨系统转托管，跨系统转托管只限于在上海证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行。

(二)登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻、质押等业务，并收取一定的手续费用。

### 十一、基金的投资

#### (一)投资目标

在运用 TIPP 投资组合保险策略进行风险预算管理的基础上，通过实施主动资产配置、精选证

券投资、金融衍生工具投资等多种积极策略,追求基金资产的持续、稳健增值。

## (二)投资范围

限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中,本基金股票投资比例范围为0~95%,权证投资比例范围为0~3%;债券投资比例范围为0~95%,资产支持证券投资比例范围为0~20%;现金以及到期日在1年以内的国债、政策性金融债等短期金融工具的资产比例不低于5%。

此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围;如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

## (三)投资策略

积极投资策略的运用是基金取得超额收益的主要来源,而严格风险预算和规范投资程序的执行是实现基金业绩持续、稳健增长的主要保证。

### 1、资产配置策略

(1)本基金将基于对宏观经济/政策、证券市场估值/趋势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置。

定量分析的主要指标包括GDP增长率、消费者价格指数(CPI)增长率、A股全市场主营业务收入增长率、A股市场收益率、国债基准收益率、A股市场平均市盈率及其变化趋势、各市场成交量及其变化趋势等;定性分析重点关注国家财政政策、货币政策、汇率政策和证券市场政策,以及经济和行业景气周期等。

(2)本基金将运用TIPP策略(时间不变性投资组合保险策略),对股票资产配置的风险进行监控。

TIPP策略的基本公式如下:

$$\begin{aligned}E_{t+1} &= M \times (A_t - F_{t+1}) \\ F_{t+1} &= \max(F_t, A_t \times \lambda) \\ \lambda &= F_0 / A_0\end{aligned}$$

其中,E表示可投资于风险资产的上限;M表示风险乘数;A表示投资组合的资产净值;F表示安全底线;而A-F即表示可承受风险的安全垫。

TIPP策略是指,期初根据投资者对风险和回报的要求设定风险控制水平( $\lambda$ ),此后,安全底线(F)不随时间调整,而是随着投资组合价值(A)的变动而调整,在投资组合价值上涨时,F上涨,锁定部分收益,在投资组合价值下跌时,F不变,保证组合安全。

本基金在实际操作中,将主要通过  $M$  和  $\lambda$  参数的设定,计算股票投资比例上限的参考值,在此基础上调整积极资产配置决策,追求在严格控制下行风险的基础上,在不同市场情况下获得稳定的回报。

## 2、股票投资策略

本基金以价值投资理念为基础,通过严谨、深入的基本面分析,追求具有健康、可持续增长潜力的股票;同时结合估值水平分析和技术面分析,追求合理买入价格和最佳买卖时机,从而在控制风险的基础上实现较高的回报。

基本面分析的主要因素包括:产品销量及增长率、营业利润率(分解为产品结构以及价格变动趋势、营运杠杆、规模经济、成本控制等)、投资效率(决定增量投资带来的盈利增长)、管理(体现在新产品研发、营运流程、客户信息管理、销售网络、环保、社会形象、人才激励、品牌和质量等)、宏观经济和产品生命周期、进出口需求和下游市场、现有行业和公司的产能利用率以及新增产能利用率等。

对于重点关注的股票,我们将随时跟踪其估值水平,并与市场、同行业估值水平进行比较,结合市场成交量、换手率、分析师指数等技术指标,为基金寻找最佳的买入、卖出时机,以降低投资成本同时控制下行风险。

## 3、债券投资策略

本基金将采取多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,为组合增加收益。

### (1)久期调整策略

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

### (2)收益率曲线配置策略

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

### (3)债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。其中,随着债券市场的发展,基金将加强对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资,主要通过信用

风险、内含选择权的价值分析和管理的价值分析和管理，获取超额收益。

#### 4、其他投资策略

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

本基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。

#### (四)投资管理体制

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

#### (五)投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

##### 1、研究

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

##### 2、资产配置决策

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

##### 3、组合构建

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

##### 4、交易执行

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

#### 5、风险与绩效评估

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

#### 6、组合监控与调整

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

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

#### (六)业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为新华富时 600 指数，债券投资的业绩比较基准为新华雷曼中国全债指数。基金整体业绩比较基准构成为：

$$\text{基准收益率} = \text{新华富时 600 指数收益率} \times 50\% + \text{新华雷曼中国全债指数收益率} \times 50\%$$

新华富时 600 指数涵盖市值最大的 600 只股票，新华雷曼中国全债指数涵盖国债、政策性金融债和企业债，市场代表性较强，适合作为本基金的业绩比较基准。

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

#### (七)风险收益特征

本基金是混合型基金，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

#### (八)投资禁止行为与比例限制

##### 1、投资禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

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

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8)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、投资组合比例限制

(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(2)本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；

(3)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(4)本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；

(5)本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8)本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10)法律法规、基金合同规定的其他限制。

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。

3、如果法律法规对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，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### （九）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

### （十）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根据本基金合同规定，于 2007 年 1 月 18 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。

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额（元）	占总资产比例
股票	2,091,812,803.60	85.53%
债券	156,835,693.20	6.41%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	141,101,519.72	5.77%
其他资产	55,985,750.63	2.29%
合计	2,445,735,767.15	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值（元）	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	76,395,535.65	3.27%
C	制造业	997,551,279.41	42.76%
C0	其中：食品、饮料	226,276,907.63	9.70%
C1	纺织、服装、皮毛	26,684,824.70	1.14%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	171,908,730.04	7.37%
C5	电子	24,883,054.86	1.07%
C6	金属、非金属	268,906,539.15	11.53%
C7	机械、设备、仪表	217,272,547.03	9.31%
C8	医药、生物制品	61,618,676.00	2.64%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	74,409,476.00	3.19%
E	建筑业	26,925,458.20	1.15%
F	交通运输、仓储业	11,960,739.18	0.51%
G	信息技术业	94,629,305.86	4.06%
H	批发和零售贸易	168,994,326.80	7.24%
I	金融、保险业	398,151,025.51	17.07%
J	房地产业	104,883,638.94	4.50%
K	社会服务业	30,832,051.73	1.32%
L	传播与文化产业	34,944,881.62	1.50%
M	综合类	72,135,084.70	3.09%
	合计	2,091,812,803.60	89.67%

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）	期末市值（元）	占净值比例
1	000568	泸州老窖	6,781,573	171,845,059.82	7.37%

2	002024	苏宁电器	3,722,342	168,994,326.80	7.24%
3	600005	武钢股份	22,038,999	140,168,033.64	6.01%
4	600016	民生银行	12,000,032	122,400,326.40	5.25%
5	600000	浦发银行	5,000,069	106,551,470.39	4.57%
6	000549	S 湘火炬	8,893,600	79,153,040.00	3.39%
7	000002	万 科 A	4,899,909	75,654,594.96	3.24%
8	000690	宝新能源	5,548,400	74,409,476.00	3.19%
9	000063	中兴通讯	1,800,000	70,380,000.00	3.02%
10	600036	招商银行	4,300,000	70,348,000.00	3.02%

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）	占净值比例
1	国 债	12,527,425.00	0.54%
2	金 融 债	139,523,000.00	5.98%
3	央行票据	-	-
4	企 业 债	-	-
5	可 转 债	4,785,268.20	0.21%
	合 计	156,835,693.20	6.72%

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）	占净值比例
1	06 国开 27	59,232,000.00	2.54%
2	06 国开 08	50,000,000.00	2.14%
3	04 国开 17	30,291,000.00	1.30%
4	02 国债(04)	11,522,325.00	0.49%
5	柳化转债	3,135,892.00	0.13%

6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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，也没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) 报告期末基金的其他资产构成

单位：元

应收申购款	25,484,804.51
应收证券清算款	21,844,858.22
其他应收款	7,006,000.00
交易保证金	910,000.00
应收利息	740,087.90

合计	55,985,750.63
----	---------------

(4) 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期内获得的权证

本报告期内，本基金未获得权证。

## 十二、基金的业绩

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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的过往业绩不代表未来表现。

### (一) 基金业绩

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	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
2006年8月9日至 2006年12月31日	44.74%	1.02%	26.40%	0.62%	18.34%	0.40%

### (二) 基金份额收益分配情况表

	登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
第一次分红	2006-09-29	每 10 份基金 份额 1.60 元	79,963,838.00	36,162.00	80,000,000.00
合计		每 10 份基金 份额 1.60 元	79,963,838.00	36,162.00	80,000,000.00

## 十三、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证券、银行存款本息、应收申购款及其他资产的价值总和。

### (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

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

#### (四)基金财产的处分

本基金的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。基金投资或运作取得的财产和收益,归入基金资产。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,基金资产不属于其清算财产。基金资产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销;不同基金资产的债权债务,不得相互抵销。非因基金资产本身承担的债务,不得对基金资产强制执行。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《基金法》等相关法律法规及基金合同另有规定,基金资产不得被处分。

### 十四、基金资产的估值

#### (一)估值日

本基金合同生效后,每开放日对基金资产进行估值。

#### (二)估值方法

##### 1、股票估值方法

(1)上市股票按估值日其所在证券交易所的收盘价计算;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价计算。

(2)未上市股票的估值:

①送股、转增股、配股和增发新股,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;

②首次发行的股票,按成本价估值。

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

##### 2、债券估值方法

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

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

(3)在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值。

(4)未上市债券按其成本价估值。

##### 3、.其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定或行业约定进行估值。

4、在任何情况下，基金管理人如采用本款第1、2、3项规定的方法对基金资产进行估值，均应当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款第1、2、3项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (三)估值对象

基金依法拥有的股票、债券等有价值证券。

### (四)估值程序与基金净值的确认

基金的日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果报送基金托管人，基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后将复核结果返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。

### (五)估值错误的处理

1、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。

2、基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

3、因基金份额净值计价错误而给投资者造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失。基金管理人在赔偿基金投资者后，有权向有关责任方追偿。基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利。

4、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

### (六)暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

### (七)特殊情形的处理

1、基金按本条第(二)款第4项规定进行估值时，所造成的差异不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券市场及登记结算机构发送的数据错误，或由于不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必

要措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益与分配

### （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、债券利息收入；
- 2、买卖证券价差收入；
- 3、存款利息收入；
- 4、其他收入。

因运用基金财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、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。
- 3、基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。
- 5、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金方可进行收益分配。本基金收益每年最多分配12次。基金收益分配比例每次不低于符合上述基金分红条件的可分配收益的60%。
- 6、基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额；如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式。
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）基金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，由基金托管人复核，并在报中国证监会备案后2个工作日内公告。基金收益分配方案须载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （五）基金收益分配费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所

获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用, 登记结算机构自动将该基金份额持有人的现金红利按红利发放日的基金份额净值转为基金份额。

## 十六、基金的费用与税收

### (一)基金运作费用

#### 1、基金费用的种类

基金运作过程中, 从基金财产中支付的费用包括:

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(4)基金份额持有人大会费用;

(5)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用;

(6)基金的资金汇划费用;

(7)按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

#### 2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

##### (1)基金管理人的管理费

在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值的 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5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

##### (2)基金托管人的托管费

在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的 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5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

(4)本条第(一)款第1项中第(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，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

3、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费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素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。

(二)基金销售费用

1、申购费用

申购费率如下：

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	1.5%
100 万元以上(含 100 万元)-500 万元以下	1.2%
500 万元以上(含 500 万元)-1000 万元以下	0.8%
1000万元以上(含1000万元)	每笔500元

本基金申购费由申购人承担，在投资者申购基金份额时收取，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、赎回费用

(1)对于投资者持有的代码为“519028”的基金份额，赎回费率如下：

持有期*	赎回费率
3 个月以内	1.5%
满 3 个月不满 1 年	0.5%
满 1 年不满 2 年	0.2%
满 2 年以后	0

\*持有期自基金开放日常申购、赎回日 2006 年 10 月 13 日起计算。赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，对于持有不满 3 个月赎回的，所收取赎回费全部归入基金资产；对于持有 3 个月以上赎回的，所收取赎回费的 25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

(3)对于投资者持有的代码为“519029”的基金份额，赎回费率如下：

持有期*	赎回费率
1 年以内	0.5%
满 1 年不满 2 年	0.2%

满2年以后	0
-------	---

\*对于集中申购所得份额,持有期自基金开放日常申购、赎回日2006年10月13日起计算。赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。所收取赎回费的25%归入基金资产,其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

(4)赎回确认时,按照先进先出原则进行处理。

### 3、申购份数的计算

对于办理集中申购的投资者,申购份数的计算方法如下:

$$\text{集中申购费用} = \text{集中申购金额} \times \text{适用集中申购费率} (\text{或} = \text{固定金额})$$

$$\text{净申购金额} = \text{集中申购金额} - \text{集中申购费用} + \text{集中申购期间利息}$$

$$\text{集中申购份数} = \text{净申购金额} / \text{集中申购验资结束当日基金份额净值}$$

对于办理日常申购的投资者,申购份数的计算方法如下:

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{适用申购费率} (\text{或} = \text{固定金额})$$

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

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

对于办理场内申购的投资者,申购份数的计算采用截尾法保留至整数位,不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。对于办理场外申购的投资者,申购份数的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

### 4、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下:

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

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

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

5、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式,并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。

### (三)税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### (一)基金会计年度、记账本位币与会计核算制度

1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。

- 2、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、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。

## (二)基金审计

- 1、基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的,具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。
- 2、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备案后2个工作日内公告。
- 3、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。

## 十八、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其实施细则、基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种指定媒体公告。

### (一)基金合同、托管协议、招募说明书

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

基金管理人应当在集中申购期开始3日前,将招募说明书登载在指定报刊和网站上。

自本基金合同生效后,基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

### (二)集中申购公告

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

### (三)基金开始申购、赎回公告

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

### (四)基金资产净值、基金份额净值公告

本基金合同生效后,在集中申购期开始之前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

自集中申购期开始之日起，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### (五)定期报告

本基金定期报告包括季度报告、半年度报告和年度报告，由基金管理人按照相关规定进行编制，经基金托管人复核后公告，同时报中国证监会备案。

- 1、季度报告：基金季度报告在每季度结束后的15个工作日内公告。
- 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、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。
- 4、法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### (六)临时公告

基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事项时，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。

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 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、基金集中申购期的延长或提前终止；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管

人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值的0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换登记结算机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购费率、赎回费率或收费方式发生变更；
- 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、基金暂停办理申购、赎回；
- 26、基金重新开始办理申购、赎回；
- 27、基金推出新业务或服务；
- 28、其他重大事项。

#### (七)信息披露文件的存放与查阅

本基金合同、托管协议、招募说明书、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人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印件或复印件。

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。

## 十九、风险揭示

### (一)投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括：

(1)国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

(2)宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

(3)上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括：

(1)市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

(2)债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

(3)债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

## 2、流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

## 3、积极管理风险

在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

## 4、操作或技术风险

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或者人为因素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、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

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、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 5、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## (二)声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但是，本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十、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

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

但如属于基金合同第九条第(一)款规定的不需召开基金份额持有人大会的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情况。

发生上述情形之一的，基金管理人应及时公告，并按法律法规和基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起，基金合同终止。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

(1)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资产安全的职责。

(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。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。

#### 2、清算程序

- (1)基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行评估和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)请会计师事务所对清算报告进行审计，请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7)对基金财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在 2 个工作日内公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《华夏华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》。

### “八、基金合同的当事人及其权利与义务

#### (一)基金管理人

#### 2、基金管理人的权利

(1)运用基金财产；

(2)获得管理人报酬；

(3)依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4)在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5)根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会、银行业监督

管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6)在基金托管人更换时，提名新任基金托管人；

(7)选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(8)选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册；

(9)在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；

(10)在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资、融券；

(11)依法召集基金份额持有人大会；

(12)法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

(1)依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2)办理基金备案手续；

(3)自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7)依法接受基金托管人的监督；

(8)计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(10)按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12)编制中期和年度基金报告；

(13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14)保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

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

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

(17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

(19)组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21)基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

## (二)基金托管人

### 2、基金托管人的权利

(1)获得基金托管费；

(2)监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3)自基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

(4)在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5)根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6)依法召集基金份额持有人大会；

(7)法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

(1)安全保管基金财产；

(2)设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3)对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

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

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(7)保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(8)对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(9)建立并保存基金份额持有人名册；

(10)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(11)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；

(12)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(13)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(14)按照规定监督基金管理人的投资运作；

(15)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(16)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；

(17)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；

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

(19)基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(20)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### (三)基金份额持有人

#### 1、基金份额持有人的权利

(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提起诉讼；

(9)法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

(1)遵守法律法规及基金合同；

(2)交纳基金申购款项及规定的费用；

(3)在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

(5)执行基金份额持有人大会的决议；

(6)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、销售机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(7)法律法规、基金合同规定的其他义务。

## 九、基金份额持有人大会

### (一)召开事由

1、有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

(1)变更基金类别；

(2)变更基金投资目标、范围或策略；

(3)变更基金份额持有人大会程序；

(4)终止基金合同；

(5)转换基金运作方式；

(6)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；

(7)更换基金管理人、基金托管人；

(8)与其他基金合并；

(9)法律法规或中国证监会规定的其他情形。

2、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(4)经中国证监会允许，基金管理人、交易所和登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5)因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(6)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(7)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(8)除法律法规、基金合同或中国证监会规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

## (二)召集人和召集方式

1、在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

## (三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

### 1、通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日，在至少一种指定媒体公告通知。

### 2、通知内容

基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2)会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3)确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4)代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机构及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定

地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### (四)基金份额持有人出席会议的方式

召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会,但终止基金合同、转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人必须以现场方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应当符合法律、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,全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的50%以上。

2、通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)大会召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

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

(3)大会召集人在公证机构的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

(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代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定;

(5)所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的50%以上。

采取通讯方式进行表决时,符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效表决;对表决事项明确放弃发表意见或表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具有效书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (五)议事内容与程序

##### 1、议事内容

议事内容限为本条前述第(一)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。

## 2、议事程序

### (1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(六)款规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。基金份额持有人大会由基金管理人召集的,大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表;基金份额持有人大会由基金托管人召集的,大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表;基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的,大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定,则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数(不含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

### (2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,由召集人至少提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决,在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机构监督下形成的决议有效。

## (六)决议形成的条件、表决方式、程序

### 1、决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

### 2、表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权,基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

### 3、表决程序

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。计票程序如下:

#### (1)现场开会

如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监

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

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。

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

## (2) 通讯方式开会

计票方式为：由大会召集人授权的 2 名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

## (七) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和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决议。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

## (八) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 十九、基金的信息披露

### (七) 信息披露文件的存放与查阅

本基金合同、托管协议、招募说明书、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人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印件或复印件。

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、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、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、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情况。

发生上述情形之一的，基金管理人应及时公告，并按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起，本基金合同终止。

## 二十二、争议的处理

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

因基金合同产生或与之相关的争议，基金合同当事人应通过协商或者调解解决，协商或者调解不能解决的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。”

本基金基金合同存放在基金管理人、基金托管人和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保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### “(一)基金管理人(或简称“管理人”)

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

成立时间：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.38 亿元人民币

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，及中国证监会批准的其他业务；因特网信息服务业务

存续期间：100 年

### “(二)基金托管人(或简称“托管人”)

名称：中国农业银行

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：杨明生

成立时间：1979 年 2 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：国发(1979)056 号

组织形式：国有独资企业

注册资本：1338.65 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。本基金投资范围、对象以及证券选择标准为：

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。权证、资产支持证券等新的金融工具在法律法规允许的范围内进行投资，不需要召开基金份额持有人大会同意。

(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

2、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

3、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

4、本基金股票投资比例范围为 0~95%，权证投资比例范围为 0~3%；债券投资比例范围为 0~95%，资产支持证券投资比例范围为 0~20%。本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规另有规定，本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：

(1)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；(2)本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%；(3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的 10%；另外，本基金投资资产支持证券目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规另有规定，本基金资产支持证券投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：(1)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；(2)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的

10%；(3)本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；(4)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

5、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

6、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的国债、政策性金融债；

7、法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。

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比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本协议第十五条基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人及时相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应以书面方式向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并承担交易对手不履行合同造成的损失，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则托管银行不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(六)基金托管人发现基金管理人的上述事项及实际投资运作中违反法律法规和《基金合同》的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，

就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

(七)对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(八)基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### 四、基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应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、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

#### 五、基金财产的保管

##### (一)基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (二)基金银行账户的变更和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的变更和管理。

2、基金托管人以本基金的名义变更基金银行账户的资料。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；亦不得使用本基金的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》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《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。

### (三)基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

### (四)基金证券账户和资金账户的变更和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司变更基金证券账户的资料。

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证券账户；亦不得使用本基金的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、在本托管协议生效日之后，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。

### (五)债券托管专户的变更和管理

《基金合同》生效后，基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司变更基金银行间债券市场债券托管账户的资料，并向中国人民银行报备。

### (六)基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证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有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。

### (七)与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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当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。

## 八、基金资产净值计算和会计核算

### (一)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、基金管理人应每开放日对基金财产估值。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开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以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，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

8、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。

## 十二、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。基金管理人和基金托管人应按照相关法律法规分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

## 十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准或备案。

### (二) 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《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。

## 十八、适用法律与争议解决方式

(一) 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 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。

(三) 除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。”

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

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

### （一）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记结算机构将其所获红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### （二）定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务，即投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资具体实施时间和业务规则将在本基金开放申购赎回后公告。

### （三）基金转换

投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。基金转换需遵守转入基金、转出基金有关基金申购赎回的业务规则。办理基金转换业务的投资者可获得一定的费率优惠，具体业务规则和办理时间将在本基金开放申购赎回后公告。

### （四）网上交易

在本公司北京、上海、广州和深圳直销网点开户的个人投资者以及持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行全国地区的金穗借记卡、兴业银行股份有限公司“兴业借记卡”或ChinaPay CD卡的个人投资者在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可登录本公司网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）或兴业银行股份有限公司网站（[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)），办理基金账户开立、基金认购、申购、赎回、转换、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务。有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站查询。另外，ChinaPayCD卡目前只有上海和厦门地区的指定银行可以办理，本公司与银联电子支付服务有限公司合作的基金网上交易业务开通地区将随ChinaPay 会员卡业务的推广而拓展。

银联电子支付服务有限公司网址：[www.chinapay.com](http://www.chinapay.com)

银联电子支付服务有限公司客户服务电话：95516

兴业银行股份有限公司的网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

### （五）呼叫中心

#### 1、自动语音服务

呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话查询最新公告信息、基金份额净值等信息。

## 2、人工座席服务

呼叫中心系统提供每周7天的人工服务。

客户服务热线电话：400-818-6666

传真：010-88066511

## (五)网上客户服务中心

网上客户服务中心为投资者提供资讯服务以及相互交流的平台。登录网站后，投资者可以通过热点问题了解基金知识和基金业务规则，投资者还可以参加“投资者论坛”和“网上嘉宾聊天室”进行讨论和交流。

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

电子信箱：[service@ChinaAMC.com](mailto:service@ChinaAMC.com)

## (六)客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

## 二十三、其他应披露事项

- 1、自合同生效以来，本基金管理人及基金托管人涉及托管业务无诉讼、仲裁事项。
- 2、本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。
- 3、本基金最新定期报告请见2007年1月19日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金2006年第四季度报告》。
- 4、本基金最新定期报告请见2007年2月7日公告的《关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金新增广州证券为代销机构的公告》。
- 5、本基金最新定期报告请见2007年2月3日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金收益分配结果公告》。
- 6、本基金最新定期报告请见2007年2月2日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金恢复办理正常申购业务的公告》。
- 7、本基金最新定期报告请见2007年2月1日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金收益分配预告》。

8、本基金最新定期报告请见2007年2月1日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金恢复办理小额申购业务的公告》。

9、本基金最新定期报告请见2007年2月1日公告的《关于华夏平稳增长混合型证券投资基金新增建设银行股份有限公司为代销机构的公告》。

10、本基金最新定期报告请见2007年1月31日公告的《关于华夏平稳增长混合型证券投资基金暂停申购业务的公告》。

11、本基金最新定期报告请见2007年1月31日公告的《关于华夏平稳增长混合型证券投资基金新增渤海证券有限责任公司为代销机构的公告》。

12、本基金最新定期报告请见2007年1月26日公告的《华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》。

13、本基金最新定期报告请见2007年1月24日公告的《华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》。

14、本基金最新定期报告请见2007年1月8日公告的《关于华夏平稳增长混合型证券投资基金开办定期定额申购业务的公告》。

15、本基金最新定期报告请见2006年12月30日公告的《华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》。

16、本基金最新定期报告请见2006年12月16日公告的《华夏基金管理有限公司关于运用自有资金进行基金投资的公告》。

17、本基金最新定期报告请见2006年12月9日公告的《华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》。

18、本基金最新定期报告请见2006年12月6日公告的《关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金新增代销机构的公告》。

19、本基金最新定期报告请见2006年10月28日公告的《华夏基金管理有限公司公告》。

20、本基金最新定期报告请见2006年10月10日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金收益分配结果暨集中申购情况公告》。

21、本基金最新定期报告请见2006年10月10日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金开放日常申购赎回业务公告》。

22、本基金最新定期报告请见2006年9月27日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金收益分配预告》。

23、本基金最新定期报告请见2006年9月20日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金新增场

内代销机构的公告》。

24、本基金最新定期报告请见2006年9月27日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金收益分配预告》。

25、本基金最新定期报告请见2006年9月27日公告的《华夏基金管理有限公司关于基金网上交易费率优惠的公告》。

26、本基金最新定期报告请见2006年8月18日公告的《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金份额转移登记公告》。

#### 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和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保证文本的内容与公告的内容完全一致。

#### 二十五、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所、营业场所。

- (一)兴业证券投资基金基金份额持有人大会决议公告
- (二)中国证监会核准兴业证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件
- (三)《华夏平稳增长混合型证券投资基金基金合同》
- (四)《华夏平稳增长混合型证券投资基金托管协议》
- (五)法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件、营业执照

华夏基金管理有限公司  
二〇〇七年三月二十六日