

中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF） 上市交易公告书

目 录

一、	重要声明与提示.....	2
二、	基金概览.....	2
三、	基金的募集与上市交易.....	3
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	5
五、	基金主要当事人简介.....	6
六、	基金合同摘要.....	8
七、	基金财务状况.....	27
八、	基金投资组合.....	28
九、	重大事件揭示.....	31
十、	基金管理人承诺.....	31
十一、	基金托管人承诺.....	32
十二、	基金上市推荐人意见.....	32
十三、	备查文件目录.....	32

中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）

上市交易公告书

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2007年4月23日

公告日期：2007年4月17日

一、重要声明与提示

中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2006年12月27日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和中欧基金管理有限公司网站(www.lcfunds.com)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金简称：中欧趋势

2、交易代码：166001

- 3、基金份额总额：6,874,704,054.16份(截止：2007年4月13日)
- 4、基金份额净值：1.1304元(截止：2007年4月13日)
- 5、本次上市交易份额：776,895,297.00份
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2007年4月23日
- 8、基金管理人：中欧基金管理有限公司
- 9、基金托管人：兴业银行股份有限公司

三、 基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况：

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会2006年11月29日证监基金字[2006]243号文批准

- 2、基金运作方式：上市契约型开放式
- 3、基金合同期限：不定期
- 4、发售日期：2007年1月4日至2007年1月23日
- 5、发售价格：1.00元人民币
- 6、发售期限：2007年1月4日至2007年1月23日
- 7、发售方式：交易所(场内)发售和柜台(场外)发售
- 8、发售机构：

(1)深圳证券交易所(场内)发售机构

已具有基金代销业务资格的深交所会员：广发证券、国泰君安证券、国信证券、招商证券、银河证券、联合证券、中信证券、海通证券、申银万国证券、广东证券、西南证券、华龙证券、大同证券、民生证券、山西证券、北京证券、长江证券、中信万通证券、广州证券、兴业证券、天同证券、华泰证券、渤海证券、金通证券、万联证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、天一证券、上海证券、国联证券、金信证券、平安证券、华安证券、东北证券、天和证券、南京证券、长城证券、东海证券、泰阳证券、国海证券、第一证券、中原证券、中银国际证券、财富证券、国都证券、恒泰证券、华西证券、东莞证券、西北证券、国盛证券、新时代证券、齐鲁证券、华林证券、宏源证券、中金公司、广发华福证券、世纪证券、德邦证券、第一创业证券、信泰证券、金元证券、江南证券、西部证

券、中信建投证券、财通证券、新时代证券。

场内代销机构的相关信息同时通过深圳证券交易所网站（www.szse.cn）登载。

(2) 柜台(场外)发售机构

1) 直销机构：中欧基金管理有限公司上海直销中心

2) 场外代销机构：兴业银行、国家邮政局邮政储汇局、国都证券、光大证券、广发证券、广发华福证券、国信证券、联合证券、齐鲁证券、申银万国证券、兴业证券、中国银河证券、招商证券、中信建投证券、宏源证券、海通证券、天相投资顾问有限公司。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况：本次募集净销售金额为人民币 6,871,163,845.62 元；认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 3,548,146.24 元，其中 3,540,208.54 元折算为基金份额归基金持有人所有，其余 7937.70 元的尾差作为其他基金资产归基金所有。上述募集资金及利息已于 2007 年 1 月 29 日全额划入本基金托管人兴业银行股份有限公司基金托管专户。

11、基金备案情况：本基金于 2007 年 1 月 29 日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2007 年 1 月 29 日获书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2007 年 1 月 29 日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：6,874,704,054.16 份。

(二) 本基金上市交易的主要内容：

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2007】40 号

2、上市交易日期：2007 年 4 月 23 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：中欧趋势

5、交易代码：166001

6、本次上市交易份额：776,895,297.00 份

7、基金资产净值的披露：包括开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间的净值揭示两部分。

基金管理人每日对基金资产估值。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。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率 I”揭示。根据《基

金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

考虑到中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）作为上市开放式基金在交易所交易的特性，仅揭示每日收市后的净值不能满足交易需求，基金管理人同深圳证券交易所协商一致，决定增加中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）的基金份额参考净值揭示频率，每交易日内定时揭示四次。交易时间内基金管理人将实时计算的基金份额参考净值传给深交所，深交所通过行情系统“市盈率II”实时揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考，基金管理人、基金托管人并不对其准确性负责，亦不对其交易作出任何保证或担保。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2007年4月13日的场内基金份额持有情况：

场内基金份额持有人户数：18,540 户

平均每户持有的场内基金份额：41,903.74 份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有 51,783,708.00 份, 占6.67%

场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例：个人持有725,111,589.00 份, 占93.33%

场内基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	用友软件股份有限公司	15,004,200.00	1.93
2	吉森财务	10,002,400.00	1.29
3	中欧基金管理有限公司	6,001,200.00	0.77
4	中国石化财务有限责任公司	5,000,600.00	0.64
5	刘仇艾	3,600,720.00	0.46
6	郝瑞申	3,001,200.00	0.39
7	南京天丰投资管理有限责任公司	3,000,300.00	0.39

8	济宁四和供热有限公司	2,400,864.00	0.31
9	吴燕芝	2,280,228.00	0.29
10	陈巧枝	2,000,840.00	0.26

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称： 中欧基金管理有限公司

2、法定代表人： 常喆

3、总经理： 卢卡·弗朗蒂尼（Luca Frontini）

4、注册资本： 1.2亿元人民币

5、注册地址： 深圳市福田区华强北路赛格广场4502A、4503A、4504A

6、设立批准文号： 中国证监会证监基字[2006]102号

7、企业法人营业执照注册号： 企合粤深总字第111505号

8、经营范围： 基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务。

9、存续期间： 持续经营

10、股东及其出资比例： 意大利隆巴达和皮埃蒙特银行股份有限公司（简称BLP）持股49%，国都证券有限责任公司持股47%，平顶山煤业（集团）有限责任公司持股4%。

（注：2007年4月1日，BLP与Banche Popolari Unite S. c. p. a. 银行之间的合并正式生效。合并后Banche Popolari Unite S. c. p. a. 银行作为存续方保留其法律主体地位，合并后的银行名字改为Unione di Banche Italiane S. c. p. a.（简称UBI Banca）。公司正在办理向监管机构报备和工商变更登记等有关手续。）

11、内部组织结构及职能： 本基金管理人下设投资研究部、市场部、运营部和监察稽核部。

投资研究部负责基金的投资、研究及交易。

运营部负责基金运营、公司财务、信息技术、人力资源和行政等工作。

市场部负责产品开发、基金销售、营销策划和客户服务等工作。

监察稽核部负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核。

12、人员情况：

截至2007年4月13日，公司共有员工40人，其中24人具有硕士及以上学历，占员工总数的60%，拥有本科及以上学历的员工共37人，占员工总数的92.5%。

13、信息披露负责人及咨询电话：黎忆海 021—68609600-2001

14、基金管理业务情况：

截至目前，中欧基金管理有限公司旗下共管理1只基金，管理资产规模约77.71亿元。

15、本基金基金经理：

殷觅智（Ian Midgley）先生，英国籍，CFA。伦敦经济学院硕士，15年以上国际与中国证券市场投资管理经验。历任瑞士银行（UBS）投资管理公司研究助理、朋友天命投资管理公司基金经理、宝源（Schroder）投资管理公司投资策划师、华安基金管理公司基金经理、汇丰（HSBC）投资管理公司上海代表处首席代表。现任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

法定代表人：高建平

注册资本：50 亿元人民币

注册地址：福州市湖东路 154 号

托管部负责人：霍建生

信息披露负责人：赵建明

电话：021-62159219

主要人员情况：兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，该部门下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处、产品研发处、企业年金中心等处室，共有员工 28 人，平均年龄 30 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

基金托管业务情况：兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2006 年 12 月 31 日，兴业银行已托管开放式基金 6 只--兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金。托管基金财产规模 66.04 亿元。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

法定代表人：杨绍信

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

经办注册会计师：汪棣 张立纲

电话：（021）61238888

六、 基金合同摘要

（一）基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金认购费、申购费、基金赎回手续费和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （4）销售基金份额；
- （5）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （6）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （7）依据本基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （8）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （11）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （12）选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(13) 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；

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(16) 依法召集基金份额持有人大会；

(17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

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

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

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

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

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

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

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册相关资料；

（23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

（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法律规规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 依法提议或召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

(5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

(20) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(21) 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。

5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

(2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，基金份额持有人的权利义务不因其基金账户名称而有所改变。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

2、召开基金份额持有人大会的事由：

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

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会议事程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

3、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

4、召集人和召集方式

- （1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- （2）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管

人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上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。

代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(4) 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。

(5) 基金份额持有人大会的召集人负责确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

(3) 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。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力；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的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(1) 现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

2) 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%（含 50%，下同）

(2) 在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额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他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与份额登记机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5)会议通知公布前已报中国证监会备案。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本基金合同规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

A、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

B、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

5) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，再确定和公布监票人，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。

大会由大会召集人的授权代表主持。如召集人为基金份额持有人，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 特别决议

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

2) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除上述 1)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；

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开

9、计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

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

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序；如基金管理人或基金托管人经通知但拒不派代表监督，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，表决效力不受影响。

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。

10、大会决议生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起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3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。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

（4）相关法律法规或中国证监会取消上述相关限制或变更上述相关规定的，按照变更后的规定执行。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，全年分配比例不低于年度可供分配收益的50%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（3）场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（4）基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

（5）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

（6）每一基金份额享有同等分配权；

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、收益分配方案

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

3、收益分配的时间和程序

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

（2）在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金上市费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 银行汇划费用；
- (9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 上述第 1 点中 3—9 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额，从基金财产中列支。

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的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(五) 基金财产的投资方向和投资限制

1、投资方向

本基金的投资范围为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、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股等；债券投资范围包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金大类资产的投资比例范围是：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产占基金资产的 0—35%，现金及剩余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%。

2、投资限制

(1) 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1) 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) 本基金持有的全部权证，其市值不得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一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- 5) 进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- 6) 股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产占基金资产的 0%—35%；现金及剩

余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%；

7) 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；

8) 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 5%；

9) 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、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 1)—6) 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1) 承销证券；

2) 向他人贷款或者提供担保；

3) 从事承担无限责任的投资；

4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

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

7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述投资限制或禁止行为的，本基金可不受上述限制。

(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金份额总数

本基金的估值对象为基金所持有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日。

本基金按以下方式进行估值：

（1）已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

1) 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) 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。

上市流通的权证，按估值日该权证在证券交易所的收盘价计算；该日无交易的权证，以最近一个交易日的收盘价计算。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行的股票和未上市债券，按成本估值；

3) 未上市流通的权证，按照最能反映权证公允价值的价格估值；

4) 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；

5) 未上市债券按购入成本加计至估值日为止的应计利息额计算。

（3）银行间债券市场债券按成本估值。

（4）如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

（5）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上

充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金資產淨值的計算結果對外予以公布。

基金管理人和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，应及时改正，并报告中国证监会。对基金或基金份额持有人造成损害的，按各自应承担的责任对基金或基金份额持有人进行赔偿。

2、基金资产净值的公告方式

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

（2）在开始办理基金份额申购或者赎回后，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；

（3）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。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

（1）基金合同发生以下对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的变更，须召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意。

- 1) 转换基金运作方式；
- 2) 变更基金类别；
- 3) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 4) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 5) 更换基金管理人、基金托管人；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规和中国证监会的要求提高该等报酬标准的除外；
- 7) 本基金与其他基金合并；
- 8) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他事项。

关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，并自生效之日起3日内公告。

（2）但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会核准或备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行变更；
- 4) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 法律法规、证监会或基金合同认定的其他情形。

以上变更不须召开基金份额持有人大会，但基金合同在变更后应报中国证监会核准或备案，并在中国证监会核准或备案后3日内公告；基金合同的变更内容自公告之日起生效。

2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- （3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- （4）基金合并、撤销；
- （5）法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

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

（5）基金财产清算程序：

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 基金清算组作出清算报告；
- 5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算报告报中国证监会备案；
- 8) 公布基金清算报告；
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

（6）清算费用

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

（7）基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（8）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书，由基金财产清算小组报中国证监会备案后 2 日内公告。

（9）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。

（八）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交

中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册并对外散发或供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，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，但其效力应以基金合同正本为准。

七、 基金财务状况

深圳证券交易所所在中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）2007年4月13日资产负债表如下：

项 目	行次	2007 年 4 月 13 日
资产		
银行存款	1	2,697,300,373.81
清算备付金	2	20,445,495.08
交易保证金	3	3,033,717.26
应收证券清算款	4	154,924,651.05
应收股利	5	0.00
应收利息	6	2,642,945.50
应收申购款	7	0.00
其他应收款	8	0.00
股票投资—市值	9	4,521,561,354.31
其中：股票投资成本	10	3,889,837,844.32
债券投资—市值	11	366,103,518.88
其中：债券投资成本	12	363,203,764.02
权证投资	13	15,567,844.41
其中：权证投资成本	14	13,626,793.96
买入返售证券	15	0.00
待摊费用	16	77,744.50
其他资产	17	0.00
资产总计	18	7,781,657,644.80

负债		
应付证券清算款	19	0.00
应付赎回款	20	0.00
应付赎回费	21	0.00
应付管理人报酬	22	3,992,423.77
应付托管费	23	665,403.97
应付佣金	24	5,041,744.87
应付利息	25	0.00
应付收益	26	0.00
未交税金	27	0.00
其他应付款项	28	1,000,745.50
卖出回购证券款	29	0.00
短期借款	30	0.00
预提费用	31	75,445.50
其他负债	32	0.00
负债合计	33	10,775,763.61
持有人权益		
实收基金	34	6,874,704,054.16
未实现利得	35	636,564,315.30
未分配收益	36	259,613,511.73
持有人权益合计	37	7,770,881,881.19
负债及持有人权益总计	38	7,781,657,644.80

八、 基金投资组合

截止到2007年4月13日,中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）的投资组合如下:

（一）期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	4,521,561,354.31	58.11%
2	债券	366,103,518.88	4.70%
3	权证	15,567,844.41	0.20%
4	银行存款及清算备付金	2,717,745,868.89	34.93%
5	其他资产	160,679,058.31	2.06%
	合计	7,781,657,644.80	100.00%

（二）期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
----	----	---------	----------------

1	A 农、林、牧、渔业	19,076,007.53	0.24%
2	B 采掘业	477,599,015.06	6.15%
3	C 制造业	2,071,528,712.55	26.65%
其中:	C0 食品、饮料	286,802,181.07	3.69%
	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	244,438,769.53	3.14%
	C5 电子	615,860.00	0.01%
	C6 金属、非金属	761,730,306.96	9.80%
	C7 机械、设备、仪表	635,121,702.17	8.17%
	C8 医药、生物制品	142,819,892.82	1.84%
	C99 其他制造业	0.00	0.00%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	265,331,585.11	3.41%
5	E 建筑业	0.00	0.00%
6	F 交通运输、仓储业	582,751,576.40	7.50%
7	G 信息技术业	215,067,212.40	2.77%
8	H 批发和零售贸易	113,911,030.54	1.47%
9	I 金融、保险业	385,242,653.53	4.96%
10	J 房地产业	333,009,203.04	4.29%
11	K 社会服务业	5,220,997.08	0.07%
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00%
13	M 综合类	52,823,361.07	0.68%
	合计	4,521,561,354.31	58.19%

(三) 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)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	20,028,352	235,132,852.48	3.03%

2	600009	上海机场	7,426,098	222,708,679.02	2.87%
3	000002	万科A	11,538,537	215,078,329.68	2.77%
4	601398	工商银行	36,718,211	200,114,249.95	2.58%
5	600019	宝钢股份	16,309,660	175,981,231.40	2.26%
6	600900	长江电力	11,301,311	153,358,790.27	1.97%
7	600583	海油工程	3,436,192	130,609,657.92	1.68%
8	601318	中国平安	2,355,786	129,638,903.58	1.67%
9	000063	中兴通讯	2,560,820	120,614,622.00	1.55%
10	000933	神火股份	5,987,101	111,719,304.66	1.44%

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	89,852,743.56	1.15%
2	金融债	69,965,000.00	0.90%
3	央行票据	88,368,000.00	1.14%
4	企业债	117,917,775.32	1.52%
	其中：分离交易的可转换债券	49,911,960.90	0.64%
	合计	366,103,518.88	4.71%

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券名细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	07 进出 02	69,965,000.00	0.90%
2	07 国债 02	49,945,816.44	0.64%
3	07 武钢债	49,911,960.90	0.64%
4	07 央票 18	48,620,000.00	0.63%
5	07 国债 01	39,906,927.12	0.51%

(六) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号	项目	金额（元）
1	交易保证金	3,033,717.26
2	应收证券清算款	154,924,651.05
3	应收利息	2,642,945.50
4	应收申购款	0.00
5	待摊费用	77,744.50
6	其他应收款	0.00
合计		160,679,058.31

4、截止到2007年4月13日,本基金未主动投资权证,因投资认股权和债券分离交易的可转换公司债券而获配送的权证如下:

权证代码	权证名称	获配数量(份)	期末数量(份)	期末市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
580013	武钢CWB1	5,881,983	5,881,983	15,567,844.41	0.20%

5、本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

6、本报告期末本基金未持有资产支持证券。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额

持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、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等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,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。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、 备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

- (一)中国证监会核准中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)募集的文件;
- (二)中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同;
- (三)中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)托管协议;
- (四)中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)招募说明书;
- (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和营业执照;
- (八)中国证监会要求的其他文件。

存放地点:基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.lcfunds.com)查阅。

中欧基金管理有限公司

2007年4月17日