

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
基金合同

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇〇七年四月

目录

一、前言.....	1
二、释义.....	1
三、基金的基本情况.....	5
四、基金的历史沿革.....	5
五、基金的存续.....	8
六、基金份额的上市交易.....	8
七、基金份额的申购与赎回.....	9
八、基金的转托管与非交易过户等其他业务.....	14
九、基金合同的当事人及其权利与义务.....	14
十、基金份额持有人大会.....	18
十一、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序.....	23
十二、基金的托管.....	24
十三、基金份额的登记结算.....	24
十四、基金的投资.....	25
十五、基金的财产.....	30
十六、基金资产的估值.....	31
十七、基金的费用与税收.....	33
十八、基金的收益与分配.....	35
十九、基金的会计与审计.....	36
二十、基金的信息披露.....	36
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	39
二十二、违约责任.....	41
二十三、争议的处理.....	41
二十四、基金合同的效力.....	41
二十五、基金管理人和基金托管人签章.....	42

一、前言

为保护基金投资者合法权益、明确基金合同当事人的权利与义务、规范华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)运作,依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(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》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定,遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益的原则,订立《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“本基金合同”)。

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

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

二、释义

本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

基金或本基金:	指华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF),本基金由兴科证券投资基金转型而成;
兴科基金:	指兴科证券投资基金,运作方式为契约型封闭式;
基金合同或本基金合同:	指本《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)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《兴科证券投资基金基金合同》修订而成;
托管协议:	指《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)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《兴科证券投资基金托管协议》修订而成；
招募说明书：	指《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》及基金管理人对其定期做出的更新；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及其不时做出的修订；
《销售办法》：	指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及其不时做出的修订；
《运作办法》：	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指 2004 年 6 月 8 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及其不时做出的修订；
业务规则：	指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》以及中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》等相关业务规则和实施细则；
基金合同当事人：	指受本基金合同约束，根据本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：	指交通银行股份有限公司；
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：	指对包括兴科基金由封闭式基金转为上市开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)”等一系列事项的统称；
本基金合同生效日：	指本《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日，本基金合同自兴科证券投资基金终止上市之日起生效，原《兴科

	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：	指投资者按本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；
交易：	指基金上市期间，投资者通过交易所会员单位以集中竞价等方式买卖基金份额的行为；
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(不包括交易)的统称；
场内销售：	指通过深圳证券交易所交易系统办理的基金销售业务；
场外销售：	指不通过深圳证券交易所交易系统，而通过各销售机构柜台系统办理的基金销售业务；
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，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位；
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；
深圳证券账户：	指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户(简称“A 股账户”)或证券投资基金账户(简称“基金账户”)，投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、申购、赎回等业务时需持有深圳证券账户；
开放式基金账户：	指投资者以深圳证券账户为基础、在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，投资者办理场外申购、赎回等业务时需具有

	开放式基金账户；
证券登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
基金登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，又简称为TA系统；
系统内转托管：	指投资者将托管在某场内代销机构(或营业网点)的基金份额转托管到其他场内代销机构(或其他营业网点)，或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到其他场外代销机构或基金管理人的行为；
跨系统转托管：	指投资者将托管在某场内代销机构的基金份额转托管到基金管理人或某场外代销机构，或将托管在基金管理人或某场外代销机构的基金份额转托管到某场内代销机构的行为；
基金存续期：	指自《兴科证券投资基金基金合同》生效之日起至本《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
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、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
基金资产总值：	指基金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、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。
-------	---

三、基金的基本情况

- (一)基金的名称：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)。
- (二)基金的类别：混合型基金。
- (三)基金的运作方式：契约型上市开放式基金。
- (四)基金的投资目标：追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
- (五)基金份额初始面值：1.00元。
- (六)基金存续期限：不定期。

四、基金的历史沿革

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)由兴科证券投资基金转型而成。

(一)兴科证券投资基金

兴科证券投资基金是依据《证券投资基金管理暂行办法》、国务院关于原有投资基金清理规范的有关规定和中国证监会《关于江苏省原有投资基金清理规范实施方案的批复》(证监基金字[2000]11 号)、《关于陕西省原有投资基金清理规范实施方案的批复》(证监基金字[2000]12 号)、《关于同意陕信基金等 5 只原有投资基金规范合并为兴科证券投资基金并申请上市的批复》(证监基金字[2000]43 号)、《关于兴科证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2000]44 号)，由陕信基金、长安基金、南京基金、通信基金和常信基金等五只基金经清理规范后合并而成的契约型封闭式证券投资基金。

兴科证券投资基金的基金发起人为华夏基金管理有限公司和陕西证券有限公司(已重组为“西部证券股份有限公司”)，基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。基金管理人和基金托管人已于 2000 年 4 月 8 日正式接管兴科证券投资基金，基金规模为 226,659,366 份基金单位。基金存续期为 10 年(1992 年 5 月 31 日至 2002 年 5 月 30 日)。

依据中国证监会《关于兴科证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2000]第 44 号)，经深圳证券交易所深证上[2000]101 号文批准，兴科证券投资基金于 2000 年 7 月 18 日在深圳证券交易所挂牌交易。兴科证券投资基金于 2000 年 9 月 5 日完成扩募，基金规模扩募至 5 亿份基金份额，扩募后基金存续期限延长 5 年(至 2007 年 5 月 30 日)。

2007年4月2日，兴科证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了兴科基金转型议案，内容包括兴科基金由封闭式基金转为上市开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会2007年4月13日证监基金字[2007]107号文核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，基金管理人将向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《兴科证券投资基金基金合同》失效，《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，基金正式转型为上市开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)”。

(二) 陕信基金、长安基金、南京基金、通信基金和常信基金等五只基金

陕信基金原名工行信托投资受益债券，是1992年经中国人民银行陕西省分行陕银复字[1992]29号《关于中国工商银行陕西省信托投资公司发行信托投资受益证券的批复》批准，由中国工商银行陕西省信托投资公司发起设立的契约型、封闭式受益证券，发行总额为5000万单位，每份单位面额为1.00元人民币，期限为10年。受益债券可分配收益是收入总额扣除费用后的净收益，分为固定收益和浮动收益。托管人为工行陕西省分行营业部。发起人和管理人为陕西信托投资有限公司。1997年经陕西信托投资受益证券受益人大会决议，更名为陕信基金。基金主要投资于国债和股票，有部分资金进行了实业投资。经中国人民银行陕西省分行[1994]陕银便管字12号文件批准，于1997年10月10日在沈阳交易中心挂牌交易。根据国务院国办发[1999]28号文《国务院办公厅转发证监会关于原有投资基金清理规范方案的通知》的精神，本基金于1999年6月1日停盘。

长安基金原名陕西省证券公司投资受益债券，是经中国人民银行陕西省分行《关于陕西省证券公司投资受益债券的批复》(陕银复[1992]20号)于1992年5月3日批准发行的。发行规模为3000万元人民币，期限为5年，本金到期后一次返还。受益债券利率由固定利率部分和浮动利率部分构成，固定利率部分按当年一年定期储蓄利率计算，如遇利率调整，实行分段计息。1993年1月20日，经中国人民银行陕西省分行[1993]陕银便管字第03号文件批复，发行规模增至3100万元。1994年3月1日，中国人民银行陕西省分行下发《关于同意陕西省证券公司投资受益债券转换为投资基金的批复》(陕银复[1994]11号)文件，陕西省证券公司投资受益债券更名为长安投资基金，存续期为15年封闭式契约型基金(含原投资受益债券5年存续期在内)。长安投资基金发起人和管理人均均为陕西证券有限公司。基金主要投资于国债和股票，有少量资金进行股权投资。经1996年度基金持有人大会审议，当年分红为每10份送2份，基金规模为3720万份。1997年10月23日，长安基金在沈阳证券交易中心挂牌交易。1999年6月1日，根据《国务院办公厅转发证监会关于原有投

资基金清理规范方案的通知》(国办发[1999]28号)文件精神，长安基金于1999年6月1日在沈阳证券交易中心摘牌。

南京基金原名南京市国际信托投资公司信托投资受益债券，是经中国人民银行南京市分行《关于同意你公司发行投资受益债券的批复》(宁人银管[1992]第225号)于1992年5月6日批准发行的。发行规模为3000万元人民币，期限为9年，本金到期后一次返还。受益债券利率按不低于同期银行定期储蓄利率计算。1994年1月21日，中国人民银行南京市分行下发《关于同意南京国际信托投资公司信托投资受益基金在武汉证券交易中心上市的批复》(宁人银管[1994]第33号)文件，债券转为基金(简称南京基金)，原债券9年存续期不变，基金管理人为南京市国际信托投资公司基金管理部，托管人为南京市国际信托投资公司。基金主要从事于房地产及股权投资。经武汉证券交易中心(武证交[1994]第22号)《关于同意“南京基金”在武汉证券交易中心上市的批复》，南京基金于1994年6月在武汉证券交易中心挂牌交易。

通信基金原名南通市信托投资公司信托投资受益债券，是经中国人民银行江苏省分行《关于同意发行信托投资受益债券的批复》(苏银发[1992]226号)于1992年5月15日批准发行的。发行规模为5000万元，期限为10年，本金到期后一次返还。受益债券年收益率最低不低于每一结益期开始的3年期定期储蓄存款的年利率。通信基金发起人、管理人和托管人均为南通市信托投资公司。基金主要投资于国债和股票。1994年1月26日，经武汉证券交易中心[1994]第5号文批准，通信基金在该中心挂牌交易。

常信基金原名常州市信托投资公司信托投资受益债券，是经中国人民银行江苏省分行《关于同意发行信托投资受益债券的批复》(苏银发[1992]227号)于1992年5月15日批准发行的。发行规模为5000万元人民币，实际发行5317.35万元，期限12年，每1年为1个结益期，结益1次。收益率随债券资金的营运收益多少而浮动，但年收益率最低不低于每一结益期开始的1年期定期储蓄存款的年利率。1994年2月在武汉证券交易中心挂牌上市，基金发起人和管理人为常州市信托投资公司。

根据《国务院办公厅转发证监会关于原有投资基金清理规范方案的通知》的有关规定，以上五只基金属于应清理规范的投资基金。根据中国证监会证监基金字[2000]11号文和[2000]12号文件精神，以上五只基金进行了规范重组。原基金分别于2000年3月7日以通讯方式召开基金临时持有人大会，会议通过了摘牌、进行资产置换、合并、基金资产移交、更换基金管理人、更换基金托管人、更名、审议新基金契约、调整存续期、上市及扩募、收益分配、授权等十二项决议。陕信基金、长安基金、南京基金、通信基金和常信基金合并为“兴科证券投资基金”。2000年3月22

日，南京基金、通信基金和常信基金在武汉证券交易中心摘牌(陕信基金和长安基金已于1999年6月1日摘牌)。

五、基金的存续

(一)基金份额的变更登记

自兴科基金终止上市之日起2个工作日内，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司取得终止上市权益登记日的基金份额持有人名册之后，将进行基金份额更名以及必要的信息变更，中国证券登记结算有限责任公司将根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

(二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

六、基金份额的上市交易

(一)基金在深圳证券交易所的上市

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

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

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

(二)基金在深圳证券交易所的交易

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

(三)基金在深圳证券交易所暂停上市的情形和处理方式

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

- 1.基金不再具备本条第(一)款规定的上市条件；

- 2.基金违反法律法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3.基金严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的；
- 4.深圳证券交易所认为应当暂停基金上市的其他情形。

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

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

(四)基金在深圳证券交易所终止上市的情形和处理方式

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

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

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

七、基金份额的申购与赎回

(一)申购和赎回场所

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

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

(二)申购和赎回对象

中华人民共和国境内的自然人、法人及其他组织(法律法规禁止购买证券投资基金者除外)，合格境外机构投资者，以及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。

(三)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

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

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在至少一种指定媒体公告。

(四) 申购和赎回的原则

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

2. 本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

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

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

(五) 申购和赎回的程序

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

2. 申购和赎回申请的确认

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。

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. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功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，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

(六) 申购和赎回的数额限制

本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

(七) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 本基金的申购、赎回价格以受理申请当日的基金份额净值为基准，加/减申购费用、赎回费用后计算确定。具体计算公式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

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

3. 本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。本基金申购费可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取。在申购时收取的申购费称为前端申购费，在赎回时收取的申购费称为后端申购费。前/后端申购费率最高不超过3%。

4. 本基金赎回费由赎回人承担，其中须依法扣除不低于所收取赎回费总额的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。本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取，赎回费率最高不超过5%。

5. 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须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。

6. 经中国证监会允许，基金管理人可以在遵守法律法规及基金合同规定的条件下，针对特定期间或符合特定条件的投资者，采取调低基金申购费、赎回费或调高基金赎回费等措施，基金管理人须于该等措施实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。

(八) 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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
4. 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，或其他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利益的情形；
5. 因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的；
6. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；
7. 深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购业务的；
8. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当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。

(九) 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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
4. 基金连续两个开放日以上发生巨额赎回；
5. 深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回业务的；
6. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人在有能力兑付时，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 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。

(十) 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，或认为为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个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。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

(十一) 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。

(十二)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。

八、基金的转托管与非交易过户等其他业务

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

九、基金合同的当事人及其权利与义务

(一)基金管理人

1.基本情况

名称：华夏基金管理有限公司

注册地址：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

设立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：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

存续期间：100 年

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、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；

(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

1.基本情况

名称：交通银行股份有限公司(简称：交通银行)

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：蒋超良

成立日期：1987 年 3 月 30 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：458.04 亿元

存续期间：持续经营

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

基金投资者自依本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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

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、基金合同、业务规则以及其他有关规定；
- (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。

十、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)终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(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、交易、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、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等。如召集人为基金管理人，还应另行通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

(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)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，连续公布相关提示性公告；

(2)召集人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)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。

如果开会时未达到上述条件，召集人可另行确定并公告重新表决的时间，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日可保持不变。

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

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，首先由召集人按照下列第(六)款规定程序确定和公布监票人，然后由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，首先由召集人在会议通知中公布提案，然后在所通知的表决截止日期第二个工作日，由召集人在公证机构及监督人的监督下统计全部有效表决，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

基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表。如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与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。如果采用通讯方式进行表决的，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(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。

十一、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序

(一)基金管理人的更换

1. 有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

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

2. 基金管理人的更换程序

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

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

(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：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由召集人报中国证监会核准，并应在中国证监会核准后2个工作日内在至少一种指定媒体公告。

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

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

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

(二)基金托管人的更换

1. 有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

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

2. 基金托管人的更换程序

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

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

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由召集人报中国证监会核准，并应在中国证监会核准后2个工作日内在至少一种指定媒体公告。

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

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

十二、基金的托管

本基金资产由基金托管人保管。基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十三、基金份额的登记结算

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

本基金份额采用分系统登记原则。投资者通过证券经营机构在深圳证券交易所申购或交易买入的基金份额，登记在证券登记系统，以投资者证券账户记载，托管在证券经营机构处；投资者通过

基金管理人及场外代销机构申购的基金份额，登记在基金登记系统，以投资者开放式基金账户记载，托管在基金管理人或场外代销机构处。

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

(一)登记结算机构的权利

- 1.取得登记结算费；
- 2.保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 3.法律法规、基金合同规定的其他权利。

(二)登记结算机构的义务

- 1.配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 2.严格按照法律法规和本基金合同规定办理本基金的登记结算业务；
- 3.按本基金合同及招募说明书规定为投资者办理转托管、非交易过户等业务，提供基金收益分配等其他服务；
- 4.对基金份额持有人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查等情形除外；
- 5.法律法规、基金合同规定的其他义务。

十四、基金的投资

(一)投资目标

追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

(二)投资范围

限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后，本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。

其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 20%~95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0~80%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

1.资产配置策略

本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

2.股票投资策略

本基金总体上采取“核心-卫星策略”，即将基金股票资产分成两部分，其中核心部分在投资组合中占较大比重(不低于股票资产的 80%)，投资较为稳定，对整个投资组合的长期风险收益特征起到决定性作用；卫星部分在投资组合中占权重较小，投资更加主动、积极和灵活，以追求超额收益为目标。

本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股，以分享中国经济成长；卫星组合则采取多种策略，积极投资于新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。由于核心组合与卫星组合之间相关性较低，还能够有效地分散基金整体组合的风险，从而实现在有效控制风险的前提下追求基金资产的稳健、持续增值。

(1)核心组合投资策略

本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股。大盘蓝筹股是指市值规模较大(总市值不低于 15 亿元)、且具有以下特征的股票：

公司在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等；

公司经营管理团队稳定、治理结构良好；

公司财务指标健康、收入增长和盈利水平较高；

市场估值相对于公司资产价值和增长潜力而言处于合理区间。

中国经济正处于持续、快速成长的阶段，由于大盘蓝筹股在行业中处于领先地位，具备较高的市场占有率和市场影响力，因而能够获得更多的资源和支持，充分分享经济成长的果实，并将其转化为企业自身的业绩增长动力。而且，在我国证券市场上，随着机构投资者所占比重越来越高，对市场的影响力也越来越大，由于大盘蓝筹股在流动性和风险方面具有比较优势，将成为机构投资者的核心组合，从而获得资金面支持。因此，我们认为，投资于大盘蓝筹股将在较低风险下实现基金资产的稳健增值。

(2)卫星组合投资策略

本基金卫星组合将采取多种积极策略，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。目前，基金主要关注新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等机会，通过积极操作，为整个组合扩大增值空间。

新股申购：基金将利用规模优势和定价优势，积极参与新股申购、定向增发等，把握一级市场与二级市场的差价机会，获取低风险收益。

中小盘股：与大盘股相比，中小型企业的增长性更高、收益潜力更大，但个股风险也较高。基金将通过深入研究、精选个股，把握中小板块的成长机会，以实现超越市场平均水平的较高收益。

资产重组板块：随着股权分置改革的完成，越来越多的大股东愿意通过整体上市、收购兼并、资产重组等形式，把优质资产注入上市公司，以提升公司业绩，并实现市值的更大增长。重组概念将成为未来一段时间内驱动公司业绩增长的重要因素，基金将积极把握其中机会，获取超额收益。

衍生品板块：随着股指期货等衍生工具的推出和发展，基金将有可能采用组合策略对冲风险，或通过杠杆作用放大收益。基金将以定量分析模型为基础，在严格控制风险的前提下把握衍生品市场机会，追求实现较高收益。

未来，基金管理人还将根据证券市场发展，积极寻求其他投资机会，对卫星组合投资策略进行丰富和调整。

3. 债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

(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。

(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，获取超额收益。

(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；交易管理部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

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

5.风险与绩效评估

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

6.组合监控与调整

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

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

(六)业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基金整体业绩比较基准构成为：

$$\text{基准收益率} = \text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{上证国债指数收益率} \times 40\%$$

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

本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

(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。

基金管理人应当自集中申购期结束后 1 个月内使本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。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。

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。

十五、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

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

(四)基金财产的处分

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。

十六、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)估值对象

基金依法拥有的股票、债券等有价值证券。

(三)估值方法

1.股票估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，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，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

首次发行的股票，按成本价估值。

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

(4)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减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

(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。

3. 权证的估值

(1)配股权证的估值：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；

(2)认沽/认购权证的估值：从持有确认日或买入日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的认沽/认购权证投资采用适当的估值技术，按最能反映公允价值的价格估值；

(3)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)、(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)、(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(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交易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.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5.中国证监会认定的其他情形。

(七)特殊情形的处理

1.基金管理人按本条第(三)款有关估值方法规定的第1项中的第(3)小项条款、第2项中的第(5)小项条款、第3项中的第(3)小项条款进行估值时，所造成的差异不作为基金份额净值错误处理。

2.由于证券交易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。

十七、基金的费用与税收

(一)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.基金上市初费及年费；

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

5.基金份额持有人大会费用；

6.与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；

7.基金的资金汇划费用；

8.基金收益分配中发生的费用；

9.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。

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

(二)基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

1.基金管理人的管理费

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15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

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15个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

3.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。

4.本条第(一)款第3至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

(四)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。

十八、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.基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配。
- 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，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。
- 6.基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按分红权益再投资日的基金份额净值转成相应的基金份额；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分红权益再投资日的基金份额净值转为基金份额。

十九、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.会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3.基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。

二十、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其实行准则、本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、基金托管人应当将本基金合同、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)基金份额上市交易公告书

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

(五)基金资产净值、基金份额净值公告

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。

(六)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。

(七)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.基金暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 28.基金份额折算与变更登记；

29.基金推出新业务或服务；

30.其他重大事项。

(八)澄清公告

在本基金合同存续期内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会和深圳证券交易所。

(九)信息披露文件的存放与查阅

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制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十一、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。

但如属于本基金合同第十条第(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，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。

(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本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。

二十二、违约责任

(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1.不可抗力；

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

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

(二)基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成直接损失的，应承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

(三)本基金合同一方当事人违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

二十三、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。

二十四、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

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

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

(三)本基金合同自其生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等法律约束力。

(四)本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和中国银监会一式 2 份外，基金管理人和基金托管人分别持有 2 份，每份具有同等的法律效力。

二十五、基金管理人和基金托管人签章

(见下页)

基金管理人：华夏基金管理有限公司(盖章)

法定代表人或被授权人(盖章)：

签订地：北京市

签订日： 年 月 日

基金托管人：交通银行股份有限公司(盖章)

法定代表人或被授权人(签字)：

签订地：上海市

签订日： 年 月 日