

**融通新蓝筹证券投资基金  
更新招募说明书**

**(2007 年第 1 号)**

**基金管理人：融通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**日 期：二 七年四月**

## 重要提示

融通新蓝筹证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]41号文核准公开发售。核准日期为2002年7月25日。本基金为契约型开放式基金,基金合同生效日为2002年9月13日。

基金管理人保证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,投资人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3月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年3月31日(财务数据未经审计)。

## 目 录

第一节 绪言 .....	1
第二节 释义 .....	1
第三节 基金管理人 .....	2
第四节 基金托管人 .....	7
第五节 相关服务机构 .....	9
第六节 基金的募集 .....	16
第七节 基金合同的生效 .....	16
第八节 基金份额的申购与赎回 .....	17
第九节 基金的投资 .....	23
第十节 基金的业绩 .....	28
第十一节 基金的财产 .....	29
第十二节 基金资产的估值 .....	29
第十三节 基金收益的分配 .....	31
第十四节 基金的费用与税收 .....	31
第十五节 基金的会计与审计 .....	33
第十六节 基金的信息披露 .....	33
第十七节 基金的风险揭示 .....	36
第十八节 基金的终止与清算 .....	37
第十九节 基金合同的内容摘要 .....	38
第二十节 基金托管协议的内容摘要 .....	45
第二十一节 对基金份额持有人的服务 .....	49
第二十二节 其他应披露的事项 .....	50
第二十三节 招募说明书的存放及查阅方式 .....	51
第二十四节 备查文件 .....	51

## 第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》及其他有关规定编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语代表如下含义:

基金或本基金:	指融通新蓝筹证券投资基金
基金合同或本基金合同:	指《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充
发售公告:	指《融通新蓝筹证券投资基金份额发售公告》
更新招募说明书:	指本基金合同生效后每六个月公告一次的对《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》的定期更新
《基金法》:	指 2003 年 10 月 28 日由第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自 2004 年 6 月 1 日开始实施的《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》:	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》
《销售办法》:	指中国证监会 2004 年 6 月 4 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》:	指中国证监会 2004 年 6 月 10 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会
基金合同当事人:	指受基金合同约束,根据本基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人:	指融通基金管理有限公司
基金托管人:	指中国建设银行股份有限公司
直销机构:	指融通基金管理有限公司
代销机构:	指接受融通基金管理有限公司委托代为办理本基金销售业务的机构
销售机构:	指直销机构及代销机构
个人投资者:	指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证、护照等身份证件的中国居民
机构投资者:	指在中华人民共和国境内合法登记注册或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织和合格境外机构投资者
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办法》规定的条件,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
注册登记人：	本基金的注册登记人为融通基金管理有限公司或融通基金管理有限公司委托的其他符合条件的机构
存续期：	指基金合同生效并存续的不定期之期限
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
T日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
T + n日：	指自T日起第n个工作日，不包含T日
申购：	指在本基金合同生效后，投资者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
元：	人民币元
基金账户：	指注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记人办理登记过户的基金份额余额及其变动情况的账户
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：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金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基金负债总值后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力：	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等

### 第三节 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司  
注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层  
办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层  
邮政编码：518053  
法定代表人：孟立坤  
总经理：吕秋梅  
经营范围：基金管理业务；发起设立基金。  
存续期间：持续经营  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：12500 万元  
电话：0755-26948666  
联系人：吴冶平

经公司股东会审议通过，并报中国证监会（证监基金字[2006]264 号）中国商务部（商外资资审字[2006]0788 号）审核批准，公司原股东陕西省国际信托投资股份有限公司、华林证券有限责任公司分别将其持有的公司 20% 股权全部转让给日兴资产管理有限公司

(Nikko Asset Management Co., Ltd.), 公司原股东联合证券有限责任公司将其持有的公司 20% 股权全部转让给新时代证券有限责任公司。

上述股权转让事项中陕西省国际信托投资股份有限公司所持股权转让给日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 联合证券有限责任公司所持股权转让给新时代证券有限责任公司的相关变更登记手续现已办理完毕, 华林证券有限责任公司所持股权转让给日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 的相关变更登记手续正在办理中。

本次股权变更前, 本公司的股东及其出资比例为: 河北证券有限责任公司 40%、陕西省国际信托投资股份有限公司 20%、联合证券有限责任公司 20%、华林证券有限责任公司 20%。上述转让事项全部变更完成后, 公司的股东及其出资比例将为: 河北证券有限责任公司 40%、日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 40%、新时代证券有限责任公司 20%。

公司主要设立以下业务部门: 监察稽核部、市场拓展部、研究策划部、基金管理部、基金交易部、机构理财部、登记清算部、信息技术部、综合管理部、北京分公司和上海分公司; 此外, 还设有投资决策委员会和风险控制委员会。

## (二) 主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

董事长孟立坤先生, 工学博士。历任海军工程学院、太原机械学院教师; 北京市丰台区区委工程师; 河北证券有限责任公司总裁助理。2001 年至今, 任融通基金管理有限公司董事长。

独立董事曹凤岐先生, 教授。历任北京大学经济系讲师; 北京大学经济学院副教授、教授。现任北京大学光华管理学院教授、北京大学金融与证券研究中心主任、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。

独立董事强力先生, 教授。现任西北政法学院教授、经济法系副主任、经济法学硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

独立董事马金声先生, 高级经济师。历任中国人民银行办公厅副主任、主任, 金银管理司司长; 中国农业发展银行副行长; 国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长。

董事刘承运先生, 高级经济师。历任陕西省三原县县长、县委书记; 安康地区行署常务副专员。1996 年至今历任陕西省国际信托投资股份有限公司副董事长、总经理。

董事焦锋先生, 高级会计师。历任兰州炼油化工总厂财务处长、总会计师; 广东核电集团财务部经理; 大亚湾核电财务有限责任公司总经理、副董事长。2003 年至今, 任联合证券有限责任公司副董事长。

董事高洪星先生, 1962 年 9 月出生, 高级经济师, 博士学历。历任深圳发展银行总行信贷主任、深圳发展银行爱华支行行长、深圳发展银行发展大厦支行行长、中国农业发展银行广东省分行信贷处处长、中国农业发展银行珠海分行行长、国泰君安证券深圳分公司副总经理, 2003 年至今, 任华林证券有限责任公司董事长、总裁、党委副书记。

董事吕秋梅女士, 工商管理硕士。历任国信证券有限公司总裁助理; 鹏华基金管理有限公司副总经理。2001 年至今, 历任融通基金管理有限公司常务副总经理、总经理。

董事吴治平先生, 经济学硕士。历任中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部项目经理; 深圳市安信财务顾问有限公司上市策划部经理; 华夏证券有限公司深圳分公司企业购并部经理; 国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理; 鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金经理助理。2001 年至今, 历任融通基金管理有限公司监察稽核部总监、督察长。

### 2、基金管理人监事会成员

监事程燕春先生, 高级经济师。历任中国建设银行南昌市分行城北支行行长; 中国建

设银行基金托管部市场处负责人。2001 年至今，历任融通基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理。

### 3、总经理及其它高级管理人员

总经理吕秋梅女士，简历同上。

刘模林先生，副总经理，1969 年生，华中理工大学机械工程硕士。具有 13 年证券从业经验，曾任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理；融通基金管理有限公司研究策划部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监、基金管理部总监，现同时担任通宝证券投资基金基金经理和融通新蓝筹证券投资基金基金经理。

督察长吴冶平先生，简历同上。

### 4、本基金基金经理

#### (1) 现任基金经理情况

刘模林先生，简历同上。

在任职本基金基金经理前，刘模林先生担任通宝证券投资基金基金经理。

#### (2) 历任基金经理情况

自2002年9月13日至2004年7月20日期间，由詹凌蔚先生担任本基金基金经理。

自2004年7月21日起至今，由刘模林先生担任本基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### (三) 基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### (四) 基金管理人的承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照基金合同列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资；

2、本基金管理人不得从事违反《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《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，防止违反《基金法》行为的发生；

4、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：

越权或违规经营；违反基金合同或托管协议；故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；玩忽职守、滥用职权；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；其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### （五）基金经理承诺

1、依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （六）基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

##### 1、风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、声誉风险和外部风险。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

（2）识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在什么样的风险，为什么会存在以及如何引起风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低的风险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时适时加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

##### 2、内部风险控制制度

###### （1）内部风险控制遵循的原则

全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

风险控制与业务发展同等重要原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和可操作性。

###### （2）内部风险控制的内容

内部风险控制制度的内容由一系列的具体制度构成，包括：岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度等。

为保证各部门的相对独立性，应建立明确的岗位分离制度。同时实行空间隔离制度，

建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密。

各部门应本着合理、高效、尽可能减小错误发生的可能性的原则，制定本部门的作业流程。

基金投资运作实行集中交易制度，建立集中交易室，所有基金投资必须在集中交易室完成。

制定规范的信息披露管理办法，建立完善的信息资料保全系统，建立完整的会计、统计和各种业务资料的档案。

实行独立的稽核检查制度，监察稽核部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

### 3、督察长制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由董事会聘任，报中国证监会核准。

公司督察长可列席公司会议，对公司的各项运作、内部管理、制度执行及遵守法规情况进行内部监察、稽核，定期应独立出具监察稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

如发现公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和公司董事长报告。

### 4、监察稽核制度

监察稽核部的监察稽核职责：

监察稽核部门依据国家的有关法律法规、公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部负责调查、评价公司有关部门执行国家有关法律法规的情况和执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；负责调查、评价投资决策与执行情况；评价基金资产情况；负责公司基金经理、财务负责人离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

监察稽核部的监察稽核权限：

监察稽核部有权向有关部门获取文件和材料，查阅合同、协议及相关附件，检查会计凭证、帐册、报表及相关的交易记录资料，核查实物资产；有权穿越公司为控制风险和实施保密制度而设立的有形隔离和无形隔离，亦指通称的防火墙或中国墙；有权要求各业务部门提供有关经营管理计划及其执行情况，提供报表、制度、规定、办法等文件资料。经总经理同意，有权参加公司业务会议；监察公司员工遵守执业行为准则，保密制度的情况，有权要求相关人员提供相关资料和口头或书面说明；监察部对被审部门或个人正在进行的违法、违规行为有权提请被查对象注意，在报公司领导同意后有权予以制止。

### 5、财务管理制度

基金财务与公司财务在管理内容、办法、岗位设置与人员安排上进行严格的区分。财务管理的目的在于有效地提高基金管理的效益，增加公司的资金积累，妥善处理基金持有人与基金管理人、公司和公司股东之间的经济利益关系，提高基金运作和公司经营管理水平，确保基金资产和公司财产安全、完整和增值。主要内容：编制财务计划；管理公司实收资本和营运资金；管理固定资产；管理公积金、公益金；管理公司的经营收入、支出，基金费用的提取和支付；管理税金解缴、基金收益分配和公司利润分配；制定完善财务制度、负责财务分析、编制财务决算。

### 6、人事管理制度

公司人事制度是为建立正常的经营管理秩序，规范公司员工的行为，提高员工的素质和工作效率，保护员工的正当权利，促进公司的发展，根据国家有关法律法规而制定的。主要内容包括：招收录用，劳动合同，职位设置与职务任免，岗位聘任制度，人事考核，考勤制度，薪资福利，教育与培训，奖惩，辞职与辞退，退休和档案管理等。

### 7、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。

## 第四节 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：HK0939）于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。截至 2006 年 6 月 30 日止，中国建设银行总资产为人民币 51,662.42 亿元，客户存款为人民币 44,915.66 亿元，2006 年上半年实现税前利润人民币 328.14 亿元。中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。2006 年 8 月 24 日，中国建设银行在香港与美国银行签署协定，收购美国银行在香港的全资子公司美国银行（亚洲）股份有限公司 100% 的股权。中国建设银行在《银行家》2006 年公布的全球银行按一级资本排名中，名列中国银行业榜首，在世界大银行中列第 11 位。中国建设银行在《福布斯》2006 年全球领先企业榜中为第 65 名，列中国第二位。在《亚洲周刊》2006 年 7 月公布的亚洲银行 300 强排名中，中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位，被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外，在 2006 年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中，中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司治理”、“最佳派息承诺”排行榜。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队等 8 个职能处室，现有员工 80 余人。

#### (二) 主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部工作，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

#### (三) 基金托管业务经营情况

截止到 2006 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰等 11 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新

蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华 - 道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板 ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长等 44 只开放式证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### (二) 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，直接负责风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### (三) 内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### (一) 监督方法

依照《证券投资基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“证券投资基金托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### (二) 监督流程

1. 每日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，及时提醒基金管理人；发现异常情况，与基金管理人进行情况核实后，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资用途及费用等内容进行合法合规性监督。

3. 根据基金投资运作监督情况，编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作进行合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

(1) 融通基金管理有限公司深圳投资理财中心

地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：张权

联系电话：0755-26948040

传真：0755-26935005

客户服务中心电话：0755-26948088

(2) 融通基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 1241-1243 室

邮编：100032

联系人：宋雅萍

联系电话：010-88091528 转 161

传真：010-88091635

(3) 融通基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 27 层 I、J 单元

邮编：200120

联系人：林文兵

联系电话：021-58402858 转 201

传真：021-58402858 转 333

#### 2、代销机构：

(1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.cn

(2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

法定代表人：蒋超良

联系人：王玮

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(3) 深圳发展银行

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：蓝德彰

联系人：周勤

电话：0755-82088888 转 8811

传真：0755-82080714

客户服务电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

## (4) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

联系人：朱小姐、刘小姐

电话：0755-83195834、83195771

传真：0755-83195049

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

## (5) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62583439

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

## (6) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：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

联系人：权唐

电话：010-65186758

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108（免长途费）

网址：www.csc108.com

## (7) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：林建闽

电话：0755-82130833 转 2181

传真：0755-82133302

客户服务电话：800-810-8868

网址：www.guosen.com.cn

## (8) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳福田区益田路江苏大厦 38--45 层

办公地址：深圳福田区益田路江苏大厦 38--45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄健

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

客户服务电话：4008888111、0755-26951111

网址：www.newone.com.cn

## (9) 联合证券有限责任公司

注册地址：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

联系人：盛宗凌

电话：0755 - 82493561

传真：0755 - 82492187

客户服务电话：400-8888-555,0755-25125666

网址：www.lhzq.com

(10) 长江证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华下路特 8 号

办公地址：上海汉口路 130 号

法定代表人：明云成

联系人：毕艇

电话：027-65799560

传真：027-85481532

客户服务电话：027-65799883

网址：www.cz318.com.cn

(11) 东吴证券有限责任公司

注册地址：江苏省苏州市十梓街 298 号

办公地址：江苏省苏州市十梓街 298 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户服务电话：0512-96288

网址：www.dwzq.com.cn

(12) 广发证券股份有限公司

注册地址：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：广东广州天河北路大都会广场 36、37、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客户服务电话：020-87555888 转各营业网点

网址：www.gf.com.cn

(13) 中国银河证券有限责任公司

注册地址：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

联系人：郭京华

电话：010-66568587

传真：010-66568536

客户服务电话：010-68016655

网址：www.chinastock.com.cn

(14) 中信证券股份有限公司

注册地址：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  
联系人：陈忠  
电话：010-84864818 转 63266  
传真：010-84865560  
客户服务电话：010-84864818-63266  
网址：www.ecitic.com

(15) 东方证券股份有限公司  
注册地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼  
办公地址：上海市巨鹿路 756 号

法定代表人：王益民  
联系人：盛云  
电话：021-62568800-3019  
客户服务电话：021-962506  
网址：www.dfzq.com.cn

(16) 山西证券有限责任公司  
注册地址：山西省太原市迎泽大街 282 号  
办公地址：山西省太原市府西街 69 号

法定代表人：吴晋安  
联系人：邹连星、刘文康  
电话：0351-8686766、0351-8686708  
客户服务电话：0351-8686868  
网址：www.i618.com.cn

(17) 金通证券股份有限责任公司  
注册地址：杭州市凤起路 108 号  
法定代表人：应土歌

联系人：胡琦  
电话：0571-85783749  
传真：0571-85783748  
客户服务热线：0571-96598  
网址：www.bigsun.com.cn

(18) 中信万通证券有限责任公司  
注册地址：青岛市东海路 28 号

法定代表人：史洁民  
联系人：李锦  
电话：0532-85023905  
传真：0532-85023905  
客户服务热线：0532-96577  
网址：www.zxwt.com.cn

(19) 渤海证券有限责任公司  
注册地址：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  
联系人：徐焕强  
电话：022-28451883  
传真：022-28451892

客户服务热线：022-28455588

网址：www.ewww.com.cn

(20) 万联证券有限责任公司

注册地址：东风东路 836 号东峻广场 3 座 34-35 楼

法定代表人：陆景奎

联系人：徐松

电话：020-87693617

传真：020-87691530

网址：www.wlzq.com.cn

(21) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室

法人代表：岳献春

联系人：杨甦华

电话：010-85252564

传真：010-85252655

客户服务电话：0371-7639999

网址：www.msyzq.com

(22) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼

法定代表人：魏云鹏

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

客户服务电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(23) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

法定代表人：王明权

联系人：刘晨

电话：021-68816000-1587

传真：021-68817271

客户服务电话：021-68816770

网址：www.ebscn.com

(24) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区八卦三路平安大厦 3 楼

法定代表人：杨秀丽

联系人：余江

电话：0755-82440136、82450826

传真：0755-82433794

客户服务电话：95511、0755-82440136

网址：www.pa18.com

(25) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市阜南路 166 号

法定代表人：汪永平

联系人：唐泳

电话：0551-5161671

传真：0551-5161672

客户服务电话：0551-5161671

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com) 或 [www.huaans.com.cn](http://www.huaans.com.cn)

(26) 国联证券有限责任公司

注册地址：无锡市县前东街 8 号

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

电话：0510-2831662

传真：0510-2831589

客户服务电话：0510-2588168

网址：[www.gllsc.com.cn](http://www.gllsc.com.cn)

(27) 金元证券有限责任公司

联系地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：郑辉

联系人：金春

电话：0755-83025695

传真：0755-83025625

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

(28) 国都证券有限责任公司

联系地址：北京市东城区安外大街安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

业务联系人：马泽承

电话：010-64482828-390

传真：010-64482090

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(29) 第一创业证券有限责任公司

联系地址：深圳市笋岗路中民时代广场 b 座 25 楼

法定代表人：刘学民

业务联系人：梁少珍

电话：0755-25832493

传真：0755-25831718

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(30) 东北证券有限责任公司

联系地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李树

业务联系人：高新宇

电话：0431-5096710

传真：0431-5680032

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(31) 国盛证券有限责任公司

联系地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

业务联系人：万齐志

电话：0791-6289771

传真：0791-6289395

网址：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

(32) 宏源证券股份有限公司

联系地址：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 b 座 6 层

法定代表人：汤世生

业务联系人：张智红

联系电话：010-62267799-6416

传真：010 - 62294470

网址：[www.ehongyuan.com.cn](http://www.ehongyuan.com.cn)

(33) 信泰证券有限责任公司

联系地址：南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

业务联系人：舒萌菲

联系电话：025-84784782

传真：025-84784830

网址：[www.thope.com](http://www.thope.com)

(34) 恒泰证券有限责任公司

联系地址：呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：刘汝军

业务联系人：魏华

联系电话：0471-4961259

传真：0471-4961259

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(35) 华龙证券有限责任公司

联系地址：甘肃省兰州市静宁路 138 号

法定代表人：李晓安

业务联系人：王宝国

联系电话：0931-4890068

传真：0931-4890515

网址：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

(36) 上海银行

联系地址：上海市中山东二路 585 号

法定代表人：陈辛

业务联系人：张浩

联系电话：021-63371293

传真：021-63370777

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(37) 兴业证券股份有限公司

联系地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

业务联系人：杨盛芳

联系电话：021-68419393

传真：021-68419867

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(二) 注册登记人

名称：融通基金管理有限公司  
注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层  
办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层  
邮政编码：518053  
法定代表人：孟立坤  
经营范围：基金管理业务；发起设立基金。  
存续期间：持续经营  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：12500 万元  
联系人：敖敬东  
电话：0755-26948070

### （三）律师事务所和经办律师

名称：康达律师事务所  
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室  
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室  
法定代表人：傅洋  
经办律师：娄爱东、杜玉兰  
电话：010 - 85262828  
传真：010 - 85262826

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所  
注册地址：北京朝阳区北大街 6 号北海万泰大厦 802—807  
办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层  
法定发表人：葛明  
经办注册会计师：谢枫、樊淑华  
电话：010-65246688  
传真：010-85188298

## 第六节 基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等有关规定，并经中国证监会 2002 年 7 月 25 日证监基金字[2002]41 号文核准募集。募集期为 2002 年 8 月 15 日至 2002 年 9 月 6 日。经安永华明会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，共募集 2,218,864,742.31 份基金份额，有效认购户数为 46,806 户。

## 第七节 基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金合同已于 2002 年 9 月 13 日生效。

### （二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

本基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 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。存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人有权宣布本基金终止，并报中国证监会备案。法律、法规或证券监管部

门另有规定的，从其规定。

## 第八节 基金份额的申购、赎回与转换

### （一）基金投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规及有关规定禁止购买者除外）和合格的境外机构投资者。

### （二）申购、赎回与转换的办理场所

1、本公司的直销网点和公司网站（详见本招募说明书第五节）。

2、本公司委托的代销机构的营业网点（详见本招募说明书第五节）。

本公司可以根据情况变化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变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

国泰君安、中信建投、国信证券、招商证券和联合证券目前暂不办理基金转换业务。

### （三）申购、赎回与转换的开放日及时间

#### 1、申购、赎回与转换的办理时间

本基金为投资者办理申购、赎回与转换等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。目前业务办理时间为上午 9:30 至 11:30，下午 13:00 至 15:00。基金管理人可以根据实际情况调整业务办理时间。

投资者在本招募说明书约定之外的日期和时间提出申购、赎回与转换申请的，其基金份额申购、赎回与转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格；

#### 2、申购开始日

本基金合同生效后，开始接受申购的时间为 2002 年 10 月 15 日。

#### 3、赎回开始日

本基金合同生效后，开始接受赎回的时间为 2002 年 11 月 1 日。

#### 4、转换开始日

自 2006 年 11 月 21 日起，开通转换业务。目前该业务适用于本基金与本基金管理人管理的融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通行业景气证券投资基金和融通易支付货币市场证券投资基金之间的基金转换业务。

### （四）申购与赎回的原则

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

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、在限制申购的情况下，申购费用按确认的申购金额所对应的申购费率计算。

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间（目前为 15:00）以前撤销。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可根据基金运作的实际情况更改上述原则，并最迟于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

### （五）申购、赎回与转换的限制

1、投资者在代销网点的每次最低申购金额为 1,000 元人民币（含申购费，定期定额申购每次最低金额为 100 元人民币）；在直销网点的首次最低申购金额为 10 万元人民币（含申购费）。但已在直销网点有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。

2、本基金不规定赎回的最低份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。

3、投资者每次最低转换份额为 1000 份基金份额。

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购最低金额或赎回与转换最低份额的限制，最

迟在开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

#### (六) 申购、赎回与转换的程序

##### 1、申购、赎回与转换申请的提出

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回与转换的申请。

##### 2、申购、赎回与转换申请的确认

申请当日（T 日）在规定时间内受理的申请，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其办理业务的销售网点查询确认情况。

##### 3、申购与赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请确认后，赎回款项将在 T+5 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及本招募说明书有关规定处理。

#### (七) 本基金的申购费与赎回费

##### 1、申购费率

(1) 本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

(2) 本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额（含申购费）	费率
100万元以下	1.5%
100万元（含）—1,000万元	1.2%
1,000万元（含）—1亿元（含）	1.0%
超过1亿元以上部分	0

(3) 本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

持有期	后端申购费率
一年以内	1.6%
满一年不满二年	1.2%
满二年不满三年	0.8%
满三年不满四年	0.4%
满四年后	0

2、赎回费按照赎回总金额的 0.5%收取，最低赎回费为 5 元。赎回费用由赎回人承担，在扣除销售代理费用和注册登记费等相关手续费用后，余额不低于赎回费的 25%归基金财产。

3、基金管理人可以调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在招募说明书（更新）中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### (八) 申购份数、赎回金额与转入份数的计算方式

##### 1、申购份数的计算

净申购金额以四舍五入的方法保留小数点后两位，余额归基金财产；基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

##### 1) 前端收费模式

如果投资者选择缴纳前端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

前端申购费用 = 申购金额 × 前端申购费率

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份数 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

2) 如果投资者选择缴纳后端申购费用, 则申购份数的计算方法如下:

申购份数 = 申购金额 / T 日基金份额净值

例一: 假定 T 日的基金份额净值为 1.2000 元, 三笔申购金额分别为 5,000 元、100 万元和 1,000 万元。

如果投资者选择缴纳前端申购费, 则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额 (元, A)	5,000	1,000,000	10,000,000
前端申购费率 (B)	1.5%	1.2%	1.0%
前端申购费用 (元, C=A*B)	75	12,000	100,000
前端净申购金额 (元, D=A-C)	4,925	988,000	9,900,000
前端收费模式 申购份数 (份, E=D/1.2000)	4,104.17	823,333.33	8,250,000.00

如果投资者选择缴纳后端申购费, 则在申购时投资者不需缴纳任何费用, 各笔申购获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额 (元, A)	5,000	1,000,000	10,000,000
后端收费模式申购份数 (份, F=A/1.2000)	4,166.67	833,333.33	8,333,333.33

## 2、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。

赎回费以四舍五入的方法保留小数点后两位, 余额归基金财产。

### 1) 前端收费模式

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

例二: 假定 T 日的基金份额净值为 1.2000 元, 投资者赎回 10,000 份, 则:

赎回总额 = 10,000 × 1.2000 元 = 12,000 元

赎回费用 = 12,000 × 0.5% = 60 元

赎回金额 = 12,000 - 60 = 11,940 元

### 2) 后端收费模式

赎回总金额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

后端申购费 = 赎回份数 × 最小值 (申购日基金份额净值, 赎回日基金份额净值) × 对应的后端申购费率

赎回费 = 赎回总金额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总金额 - 后端申购费 - 赎回费

例三: 假如 T 日的基金份额净值为 1.1000 元, 投资者有一笔金额为 1 万元的申购, 投资者在第三年赎回该笔基金份额, 如第三年赎回时基金份额净值为 1.4000 元, 则投资者可获得赎回款 12,583.63, 投资收益率为 26%; 投资者在第四年赎回该笔基金份额, 如第四年赎回时基金份额净值为 1.6000 元, 则投资者可获得赎回款 14,432.73, 投资收益率为 44%。

计算过程如下:

	第三年赎回	第四年赎回
申购金额 (元, A)	10,000.00	10,000.00
后端申购份数 (B=A/1.1000)	9,090.91	9,090.91
赎回总金额 (C=B × 单位净值)	12,727.27	14,545.46

后端申购费率 (D)	0.80%	0.40%
后端申购费 (E=MIN(A,C) × D)	80.00	40.00
赎回费 (F=C × 0.5%)	63.64	72.73
赎回金额 (G=C-E-F)	12,583.63	14,432.73
投资收益率	26%	44%

### 3、转入份数的计算

基金的转换份数计算如下，其中，

转换金额 = 转出份数 × T 日转出基金份额净值

转换费 = 转换金额 × 转换费率

补差费 = 转换金额 × 补差费率

转入份数 = (转换金额 - 转换费 - 补差费) / T 日转入基金份额净值

基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

### 4、基金份额资产净值的计算

T 日基金份额资产净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日基金份额的余额数量

本基金份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### (九) 申购、赎回与转换的注册登记

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

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### (十) 基金转换的原则

1、基金转换的计算采用“未知价”原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金份额净值为基准进行计算。

2、采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请。

3、基金转换无基金份额持有时间限制。

4、基金转换收取适当的基金转换费和补差费。

5、基金转换转出的基金在申请日有权益，确认日开始无权益；基金转换转入的基金在申请日无权益，确认日开始记权益。

6、基金转换后的基金份额持有时间按其初始持有时间连续计算。

7、在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态。

8、在发生限制申购或巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。如果发生连续巨额赎回，基金转换不顺延。

9、由于前端费用和后端费用的费率结构差异较大，因此，基金转换只允许在缴纳前端认购（申购）费用的基金份额之间或者缴纳后端认购（申购）费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳后端认购（申购）费用的基金份额，或将缴纳后端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳前端认购（申购）费用的基金份额。

10、转换费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

11、补差费：对于前端收费模式基金，转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时，补差费为 0；转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时，按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费。对于后端收费模式基金，补差费为 0。

12、基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算，累计

不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额。

13、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。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露披刊上公告。

#### （十一）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，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可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，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的 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，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第二个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。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。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在公告，并说明有关处理方法。

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

#### （十二）拒绝或暂停申购、暂停赎回、拒绝或暂停转换的情形及处理

##### 1、暂停或拒绝申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受投资者的申购申请：

（1）基金管理人认为基金资产规模的扩大有可能对基金份额持有人的利益产生负面影响；

（2）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

（3）由于不可抗力而导致基金无法正常工作；

（4）证券交易所交易时间非正常停市；

（5）法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的其他暂停申购情形；

（6）基金管理人认为某笔申购申请可能影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请。

发生上述第（1）到第（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间，每月至少重复刊登暂停公告一次；暂停结束，基金重新开放申购时，基金管理人应在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登基金重新开放申购公告及最近一个工作日基金份额净值。

对于销售机构已受理的申购申请或发生上述第（6）项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。

##### 2、暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因出现连续巨额赎回，导致基金的现金支付出现困难，基金管理人可以暂停接受赎回申请；
- (4) 法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一时，基金管理人在当日向中国证监会报告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续工作日予以兑付，并以该工作日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。

### 3、拒绝或暂停转换的情形及处理方式

当转出基金暂停赎回，或转入基金暂停申购时，基金管理人暂停接受基金投资者的转换申请；当转入基金拒绝申购时，基金管理人拒绝接受基金投资者的转换申请。

### 4、处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回和转换申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间，基金管理人将每 2 周至少重复刊登暂停公告一次；暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人公告最近一个工作日基金份额净值。

#### (十三) 重新开放申购、赎回与转换的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回或转换公告并公布最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

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，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购、赎回或转换日公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### (十四) 非交易过户

非交易过户是指由于司法强制执行、继承、捐赠等原因，本公司将某一基金账户的基金份额全部或部分直接划转至另一账户。司法强制执行是指司法机构依据生效法律文书将基金持有人持有的基金单位强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；继承是指基金持有人死亡，其持有的基金单位由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金单位捐赠给福利性质的基金会或社会团体。办理非交易过户必须提供相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 30 个工作日内办理并按基金登记过户机构规定的标准收费。

#### (十五) 转托管

投资者可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该基金份额。投资者申购（认购）基金份额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。对于有效的基金转托管申请，基金单位将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构（网点）。

## 第九节 基金的投资

### （一）投资目标

本基金为“新蓝筹”资本增值型基金，主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金份额持有人获取长期稳定的投资收益。

### （二）投资方向

本基金的投资范围仅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、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。对“新蓝筹”企业的投资不少于股票资产的 80%，同时将根据市场状况调整投资组合，把握投资机会，实现组合的进一步优化。

### （三）投资策略

在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%；权证投资比例浮动范围：0-3%；现金留存比例浮动范围：不低于 5%。

#### 1、资产配置

贯彻“自上而下”的投资策略，结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

#### 2、行业资产配置

在“新蓝筹”投资理念的指导下，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，确定股票资产在不同行业的投资比例。

#### 3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素；另一方面考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和 GDP 增长等因素。

#### 4、股票选择

股票投资中将以“新蓝筹”资本增值型投资为主导，把企业的未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。致力于建立完善的数理统计体系，利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路，对市场运行特征进行跟踪，确保基金投资决策的科学性。同时重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

“新蓝筹”企业的主要选择标准是：

（1）行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于 6%或者 GDP 增长率；

（2）企业成长性较好，市场竞争能力强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

（3）企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高；财务管理能力较强，现金收支安排有序，资产盈利水平较高；

（4）企业财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

（5）企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位；

（6）企业管理层开拓进取，具备企业家素质，建立了科学的管理和组织架构。

#### 5、权证投资策略

##### （1）投资策略

根据权证作为衍生品品种本身的特性和作用，本基金在权证投资上主要运用以下投资策略：基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略；基于权证杠杆比率及 Delta 对冲比率分析基础上的权证替换投资策略；基于 Black-Scholes 等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

## (2) 风险控制措施

1) 实行投资授权控制，确保权证投资的审慎性。

2) 实行投资流程控制，在充分研究的基础上参与权证的投资。权证投资必须有公司内部研究报告的支持，研究报告需包含权证标的证券的投资价值分析以及权证投资价值金融工程定量分析。

3) 公司监察稽核部依据相关管理规定对权证投资管理过程的合规性进行检查。

## 6、资产支持证券的投资策略及风险控制措施

### A、投资策略

在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于资产支持证券。

#### a、买入持有策略

可在与投资目标一致的前提下，买入并持有资产支持证券，以获取相应的利息收入。

#### b、利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期，预测资产支持证券收益率的变化趋势，从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

#### c、信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

#### d、相对价值策略

通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标，将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较，确定其是否具有相对价值，从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

### B、风险控制措施

a、通过严格的投资流程控制投资风险，基金经理及有关人员必须严格执行公司投资授权制度。

b、在投资资产支持证券时，首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议，基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限，参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告，充分评估资产支持证券的风险收益特征，确定具体投资方案，在严格控制风险的前提下，谨慎进行投资。

c、基金交易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支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

d、固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估，密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素，并在投资中进行相应操作，以规避信用风险的上升。

e、固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型，并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素，并评估其对资产支持证券持有期收益的影响，并进行相应的投资操作。

f、基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排，并考虑其对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

g、基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素，并评估其对资产支持证券投资价值的影响，并进行相应的投资决策。

h、将不断完善内部控制制度及相应技术手段，使基金相关操作以谨慎安全的方式进行，确保基金及持有人利益得到保障。

i、将严格审查所投资资产支持证券的法律文件，确保各业务环节都有适当的法律保障。

#### (四) 业绩比较基准

本基金股票投资部分的比较基准是“国泰君安指数”。国泰君安指数于 1997 年底开始编制，是国内较早的同时反映两个市场的统一指数。该指数采用流通股加权的方式计算，涵盖所有在上海、深圳上市的 A 股上市公司，具有较好的连续性和可比性。

#### (五) 投资组合

投资组合的原则是追求收益性、流动性和安全性的有机结合。结合本基金的“新蓝筹”投资理念，本基金投资组合在保持基金资产流动性的条件下，将以获取资本增值为主。

本基金可投资于国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证，以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动，使得基金收益表现更加稳定；同时满足基金资产对流动性的要求。

本基金的投资组合必须符合以下规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有的同一权证不得超过该权证流通量的 10%。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%；

(6) 基金建仓期：自基金开始运作之日起，将在六个月内达到上述第(1)条、“投资范围”中关于投资于新蓝筹企业的比例规定以及“投资策略”中关于股票投资比例浮动范围、债券投资比例浮动范围、现金留存比例浮动范围的有关规定；

(7) 本基金可投资于剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券。

A、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%。

B、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%。

C、与基金管理人管理的其它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%。

D、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

E、因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第 B 项和第 D 项规定的比例，基金管理人将在 10 交易日内调整完毕。

F、投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。

G、基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(8) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致投资组合超出上述比例不在限制之内，但基金管理人应在法规规定的期限内进行调整，以达到上述标准。

#### (六) 投资决策

##### 1、决策依据

(1) 国家宏观经济环境；

- (2) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- (3) 货币政策、利率走势；
- (4) 地区及行业发展状况；
- (5) 上市公司研究；
- (6) 证券市场的走势。

## 2、决策程序

本基金管理人内部设立基金管理部、研究策划部、基金交易部、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会，进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下：

(1) 研究策划部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

(2) 基金经理根据研究策划部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，形成资产配置提案报投资决策委员会。

(3) 投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

(4) 基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

(5) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部。

(6) 基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(7) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

## (七) 投资限制

本基金禁止从事下列行为：

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

## (八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

## (九) 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2007年4月13日复核了本报告中的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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2007年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款	69,174,424.80	7.20%
清算备付金	10,220,493.67	1.07%
股票投资市值	612,002,664.99	63.72%
债券投资市值	214,025,124.10	22.28%
权证投资市值	15,722,700.00	1.64%
其他资产	39,310,890.26	4.09%
资产合计	960,456,297.82	100%

### 2、按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	32,992,368.64	3.78%
B 采掘业	--	--
C 制造业	232,800,304.80	26.69%
C0 食品、饮料	41,575,026.75	4.77%
C1 纺织、服装、皮毛	7,292,302.92	0.84%
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	2,253,656.48	0.26%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	117,289,099.76	13.45%
C5 电子	--	--
C6 金属、非金属	17,092,255.56	1.96%
C7 机械、设备、仪表	24,355,745.54	2.79%
C8 医药、生物制品	22,942,217.79	2.63%
C99 其他制造业	--	--
D 电力、煤气及水的生产和供应业	12,080,256.00	1.38%
E 建筑业	15,015,000.00	1.72%
F 交通运输、仓储业	--	--
G 信息技术业	3,249,111.64	0.37%
H 批发和零售贸易	92,924,829.95	10.65%
I 金融、保险业	174,441,267.56	20.00%
J 房地产业	10,799,360.00	1.24%
K 社会服务业	37,700,166.40	4.32%
L 传播与文化产业	--	--
M 综合类	--	--
合计	612,002,664.99	70.16%

### 3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	3,093,644	53,767,532.72	6.16%
2	600309	烟台万华	1,118,236	38,020,024.00	4.36%
3	000069	华侨城A	1,900,210	37,700,166.40	4.32%

4	600030	中信证券	801,000	34,467,030.00	3.95%
5	000972	新中基	1,338,976	32,992,368.64	3.78%
6	000001	S 深发展 A	1,743,493	32,917,147.84	3.77%
7	600016	民生银行	2,600,000	32,344,000.00	3.71%
8	600470	六国化工	2,250,000	28,395,000.00	3.26%
9	002024	苏宁电器	425,000	27,200,000.00	3.12%
10	000061	农产品	1,522,759	26,572,144.55	3.05%

## 4、按券种分类的债券投资组合

债券种类	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	176,873,324.10	20.28%
可转债	37,151,800.00	4.26%
合计	214,025,124.10	24.54%

## 5、基金投资前五名债券明细

债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
02 国债	136,115,791.90	15.61%
21 国债	40,757,532.20	4.67%
招商转债	37,151,800.00	4.26%
合计	214,025,124.10	24.54%

## 6、报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券中无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、处罚的证券；

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票；

(3) 其他资产的构成如下：

项目	金额(元)
交易保证金	1,321,735.98
应收证券清算款	458,437.09
应收利息	2,913,473.99
应收申购款	34,617,243.20
合计	39,310,890.26

(4) 本报告期内处于转股期的可转换债券

债券代码	债券名称	市值	占基金资产净值比例
125024	招商转债	37,151,800.00	4.26%

(5) 本报告期内无投资资产支持证券

(6) 本报告期内本基金投资权证业务的情况

权证名称	期间买入数量(份)	成本总额(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	类别(被动持有/主动投资)
国电 JTB1	1,230,000	9,217,763.35	1,230,000	-703,791.30	主动投资
马钢 CWB1	6,240,000	15,989,825.99	6,240,000	-1,541,285.66	主动投资
长电 CWB1	2,100,000	14,223,477.28	--	--	主动投资

## 第十节 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。

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率	净值增长率 标准差	业绩比较基准 收益率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
2002 年度	-3.18%	0.23%	-13.76%	0.87%	10.58%	-0.64%
2003 年度	19.97%	0.58%	-0.92%	0.82%	20.89%	-0.24%
2004 年度	-2.37%	0.97%	-12.21%	1.02%	9.84%	-0.05%
2005 年度	6.70%	1.01%	-10.67%	1.09%	17.37%	-0.08%
2006 年度	114.00%	1.26%	59.26%	1.09%	54.74%	0.17%

## 第十一节 基金的财产

### （一）基金财产的构成

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他财产等。

### （二）基金财产的账户

本基金以“融通新蓝筹证券投资基金”的名义开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （三）基金财产的保管及处分

- 1、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。
- 4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二节 基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日，定价时点为上述证券交易所的收市时间。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券等有价证券和银行存款本息等资产。

### （四）估值方法

1、任何上市流通的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2、未上市证券的估值：

（1）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收盘价估值；

（2）首次公开发行的股票，按成本价估值；

（3）未上市流通的债券，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，则不进行估值。

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，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。

5、以上估值原则依据中华人民共和国财政部发布的《证券投资基金会计核算办法》制定。国家如有最新规定的，按最新规定进行估值。

### （五）估值程序

基金的日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本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签章返回给基金管理人；月末、年中 and 年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （六）估值错误的确认及处理方式

基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。当基金份额净值小数点后四位以内发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当发生估值错误时，基金管理人立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因发生差错造成基金份额持有人损失的，由基金管理人负责赔偿，赔偿原则如下：

1、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份额持有人后，有权向有关责任方追偿。

2、计算的基金份额净值低于正确的基金份额净值时的处理：

（1）申购确认份额大于实际应确认份额，份额多余部分从投资者基金账户中扣减；若扣减时发现投资者基金账户内余额不足，不足部分由基金管理人赔付给基金资产；

（2）赎回确认金额小于实际应确认金额，不足部分由基金管理人赔付给投资者。

3、计算的基金份额净值高于正确的基金份额净值时的处理：

（1）申购确认份额小于实际应确认份额，份额不足部分由基金管理人赔付给投资者；

（2）赎回确认金额大于实际应确认金额，多余部分由基金管理人赔付给基金资产。

4、错误期间造成的一切管理人的策略性错误，如巨额赎回比例确定，均以当日决定为准，不予纠正。

5、基金管理人代表基金保留要求返还不当利得的权利。

6、基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成10元人民币以上的损失。

### （七）暂停估值的情形与处理

1、基金投资涉及的证券交易所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。

出现暂停估值情形时，基金管理人有权根据情况决定停止基金的申购、赎回等交易业务，并在两个工作日内编制临时公告书，予以公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

#### （八）特殊情形的处理

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 第十三节 基金收益的分配

#### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券差价；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

#### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### （三）收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- 6、投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式，单个账户中不得对同一基金同时选取两种分红方式，投资者选择分红的默认方式为现金分红。分红再投资部分以权益登记日的基金份额净值为计算基准确定再投资份额；
- 7、基金收益分配比例按照有关法律法规的规定执行；
- 8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、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。

#### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定。

基金管理人应当在两日内编制收益分配报告书，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。

### 第十四节 基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

- 1、与基金运作有关费用种类
  - （1）基金管理人的管理费；
  - （2）基金托管人的托管费；

- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金成立后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## 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

基金管理人的管理费以基金资产净值的 1.5% 年费率计提。基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述 1 中(3)到(7)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支付，列入当期基金费用。

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

## 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磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。最迟须于新的费率或收费方式实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费

(1) 本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

(2) 本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额（含申购费）	费率
100万元以下	1.5%
100万元（含）—1,000万元	1.2%
1,000万元（含）—1亿元（含）	1.0%
超过1亿元以上部分	0

(3) 本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

持有期	后端申购费率
一年以内	1.6%
满一年不满二年	1.2%
满二年不满三年	0.8%
满三年不满四年	0.4%
满四年后	0

2、赎回费按照赎回总金额的 0.5% 收取，最低赎回费为 5 元。赎回费用由赎回人承担，在扣除销售代理费用和注册登记费等相关手续费用后，余额不低于赎回费的 25% 归基金财产。

## 3、转换费用

(1) 基金转换只允许在缴纳前端申购（认购）费用的基金份额之间或者缴纳后端申购

(认购)费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳后端申购(认购)费用的基金份额,或将缴纳后端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳前端申购(认购)费用的基金份额。基金转换费用包括转换费和补差费。

(2) 转换费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

(3) 补差费:对于前端收费模式基金,转出基金的申购费率(或认购费率)高于转入基金的申购费率(或认购费率)时,补差费为 0;转出基金的申购费率(或认购费率)低于转入基金的申购费率(或认购费率)时,按申购费率(或认购费率)的差额收取补差费。对于后端收费模式基金,补差费为 0。

(4) 基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申(认)购费率为基础计算,累计不超过最高认购(申购)费率与最低认购(申购)费率的差额。

(5) 基金转换费由转换申请人承担,其中 25%归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费由转换申请人承担,作为相关的手续费。

### (三) 基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 第十五节 基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方,基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计,但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务;

2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果基金成立少于 3 个月,可以并入下一个会计年度;

3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

4、会计制度执行国家有关的会计制度;

5、本基金独立建账、独立核算;

6、基金管理人及基金托管人各自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;

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认;

8、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时,经中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会。

### (二) 基金审计

1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金进行年度审计和分红审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人和基金托管人同意,并报中国证监会备案。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所须在 5 个工作日内公告。

## 第十六节 基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。本基金信息披露事项应当在中国证监会规定时间内,通过指定报刊和网站等媒

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

公开披露的基金信息包括：

(一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

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。

基金合同是约定基金管理人、基金托管人、基金份额持有人权利、义务的法律文件。

基金托管协议是约定基金管理人和基金托管人权利、义务的法律文件。

(二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(三) 基金募集情况公告

基金管理人应当就基金份额发售的结果编制基金募集情况公告，并在募集期结束的次日登载于指定报刊和网站上。

(四) 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

(五) 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在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的3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(六) 基金资产净值、基金份额净值

本基金合同生效后，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。

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。

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将前日的基金资产净值、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) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(八) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

(九) 临时报告

基金发生重大事件，即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件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。重大事件包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 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 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

#### （十）基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十一）澄清公告

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

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

#### （十三）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及基金上市交易的证券交易所供公众查阅、复制。

基金份额净值公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第十七节 基金的风险揭示

### （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，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### 1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### 2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### 3) 利率风险

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

##### 4) 上市公司经营风险

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，从而导致基金投资收益变化。

##### 5) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

#### 3、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 4、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 5、操作或技术风险

指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、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 6、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 7、特定的基金品种、特定的投资方法及基金所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 本基金在投资风格上属于平衡型基金产品，平衡型基金的产品虽然在风险调整后收益指标方面具有长期优势，但也存在其绝对收益率在某一阶段单边市场中逊色于某些单一风格基金的可能性。风险防范措施：基金管理人将发挥专业研究与理财优势，正确预期市场发展趋势，积极调整价值成长资产配置比例，将这一风险最小化。

(2) 品种选择风险。融通新蓝筹证券投资基金的主要投资对象为处于企业成长期或成熟期早期的上市公司股票，由于中国经济发展正处在转型期，企业发展的宏观环境以及行业背景变化较大，因此处于这一特定阶段的上市公司的持续成长能力存在一定的不确定性，从而给基金投资的品种选择带来风险。风险防范措施：进一步完善数理统计体系，加强对上市公司基本面的研究，提高对公司未来发展战略、轨迹及可能的经营业绩预测的准确性。

(3) 本基金对新蓝筹品种的定义及选择是建立在中国经济中长期持续稳定增长以及这种增长的不均衡性基础之上的，如果在未来某一特定阶段内，这一预期发生了不稳定偏差，可能造成入选新蓝筹股票的代表性不强、包容性不足的风险。风险防范措施：加强宏观经济研究与预测能力，积极调整基金投资策略。

## 7、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、代理商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。投资人自愿投资于本基金，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，本基金还通过中国建设银行、交通银行、深圳发展银行、招商银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、山西证券有限责任公司、金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、金元证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、金元证券有限责任公司和信泰证券有限责任公司等代销机构代理销售。但是，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。

## 第十八节 基金的终止与清算

### (一) 基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1、存续期内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元人民币，基金管理人将宣布本基金终止；

- 2、基金经持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、中国证监会允许的其他情况。

#### (二) 基金清算小组

1、自基金终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金清算小组成员由基金发起人、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、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (三) 基金清算程序

- 1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2、基金清算小组对基金财产进行清理和确认；
- 3、对基金财产进行估价；
- 4、对基金财产进行变现；
- 5、将基金清算结果报告中国证监会；
- 6、公布基金清算公告；
- 7、进行基金剩余财产的分配。

#### (四) 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。

#### (五) 基金剩余财产的分配

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

#### (六) 基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

#### (七) 基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九节 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人的权利与义务

#### (一) 基金管理人的权利

- 1、自本基金成立之日起，依法独立运用基金资产并独立决定其投资方向和投资策略；
- 2、依据基金合同的规定，获得基金管理人的管理费；
- 3、监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家法律法规，应呈报中

中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

- 4、销售基金份额，获取认购（申购）费；
- 5、选择和更换销售代理人，并对其销售代理行为进行必要的监督；
- 6、依照有关法律法规，代表基金行使股东权利；
- 7、依据有关法律法规及本基金合同决定基金收益的分配方案；
- 8、在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，拒绝或暂停受理基金份额的申购和暂停受理基金份额的赎回申请；
- 9、法律法规及基金合同规定的其他权利。

## （二）基金管理人的义务

- 1、遵守基金合同；
- 2、自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- 3、设置相应的部门并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资产；
- 4、设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务；
- 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，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- 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资产；
- 7、接受基金托管人依法进行的监督；
- 8、负责基金登记过户。基金管理人应严格按照有关法律法规及本基金合同，办理或委托其他机构办理本基金的登记过户业务；
- 9、按规定计算并公告基金份额净值；
- 10、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 11、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、本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；
- 12、依据《基金合同》规定决定基金收益分配方案并向基金份额持有人分配基金收益；
- 13、按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
- 14、不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；
- 16、保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- 17、确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；保证基金投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- 18、参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按照基金合同规定履行义务，基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；
- 22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 23、法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金托管人的权利与义务

### （一）基金托管人的权利

- 1、依法持有并保管基金资产；
- 2、依据基金合同的规定，获得基金托管费；
- 3、监督本基金的投资运作；
- 4、法律法规及基金合同规定的其他权利。

### （二）基金托管人的义务

- 1、遵守基金合同；
  - 2、以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；
  - 3、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
  - 4、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在持有人名册保管、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
  - 5、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资产；
  - 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、以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；
  - 8、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
  - 9、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；
  - 10、采用适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；
  - 11、采用适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额的认购、申购和赎回的方法符合基金合同等有关法律文件的规定；
  - 12、采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等有关法律文件的规定；
  - 13、按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国人民银行和中国证监会；
  - 14、在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - 15、负责保存基金份额持有人名册；
  - 16、按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；
  - 17、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - 18、依据基金管理人的指令或有关规定支付基金收益和赎回款项；
  - 19、参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
  - 20、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
  - 21、因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
  - 22、基金管理人因过错造成基金资产损失时，按照有关的法律法规应为基金向基金管理人追偿；
  - 23、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
  - 24、法律、法规及基金合同规定的其他义务。
- ### 三、基金份额持有人的权利和义务

(一) 每份基金份额代表同等的权利和义务

(二) 基金份额持有人权利

- 1、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；
- 2、取得基金收益；
- 3、监督基金经营情况，按有关规定获取基金业务及财务状况的资料；
- 4、申购、赎回或转换基金份额，并在规定的时间取得有效申请的款项或基金份额；
- 5、提请基金管理人或基金托管人履行基金合同规定应尽的义务；
- 6、取得基金清算的剩余资产；
- 7、因基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构的过错导致利益受到损害，有要求赔偿的权利；
- 8、知悉基金合同规定的有关信息披露内容；
- 9、法律、法规及基金合同规定的其他权利。

(三) 基金份额持有人义务

- 1、遵守基金合同；
- 2、缴纳基金认购和申购款项，承担规定的费用；
- 3、承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 5、法律、法规及基金合同规定的其他义务。

四、基金份额持有人大会

(一) 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10%以上基金份额的基金份额持有人（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) 提前终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 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）；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- (6) 《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规、本基金合同规定的其他事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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份额的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- (4) 对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 对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) 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。

(二) 会议召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

3、代表基金份额 10% 以上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；

4、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基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

### （三）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开时间、地点、方式；
- （2）会议审议事项、议事程序、表决方式；
- （3）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）代理投票委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名、电话；
- （6）其他注意事项。

2、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）会议的召开方式

#### 1、会议方式

- （1）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；
- （2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，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；
- （3）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；
- （4）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事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金份额持有人大会召开条件

##### （1）现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当不少于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

2）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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 15 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### （2）通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前（含当日）未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 15 个工作日后），但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容仅限于本基金合同第八部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

（2）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决；

（3）基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 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；

（4）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：

1) 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；

2) 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。

##### 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，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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上的基金份额持有人召集大会时，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、住所地址、持有或者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

在通讯方式开会的条件下，由召集人在会议通知中提前 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，在公证机构监督下形成决议。

#### (六) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人不得就未经公告的事项进行表决。

3、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：一般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 50% 以上通过方为有效；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：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 2/3 以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

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、对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规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无效表决。

6、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。

#### (七) 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选举两名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三名代表担任监票人；

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

(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；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，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

在通讯方式开会的条件下，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的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

#### 五、基金合同的修改与终止

##### (二) 基金合同的终止

出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

(1) 存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元，基金管理人有权宣布本基金终止；

(2) 基金经持有人大会表决终止的；

(3) 因重大违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

(4) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；

(5) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；

(6) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

(7) 中国证监会允许的其他情形。

本基金合同终止后，须按法律法规和本基金合同对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后本基金合同终止。

#### 六、争议处理

本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，可向有管辖权的人民法院起诉，也可根据事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

#### 七、基金合同的效力

(一) 本基金合同经基金发起人、基金管理人与基金托管人三方盖章、三方法定代表人或其授权代理人签字并经中国证监会批准后生效。基金合同的有效期限自生效之日起至本基金清算结束报中国证监会批准并公告之日止。

(二) 本基金合同自生效之日起对本基金合同当事人具有同等法律约束力。

(三) 本基金合同正本一式十份，其中上报中国证监会和中国人民银行各两份，基金发起人、基金管理人和基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

(四) 本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 第二十章 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

法定代表人：孟立坤

成立时间：2001 年 5 月 22 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2001]8 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12500 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金；基金管理业务

## （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

注册地址：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

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据《基金法》、基金合同和其他有关规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产核算、基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配以及基金份额认购、申购、赎回和价格计算等行为的合法性、合规性等定期进行监督和核查。

2、基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式给托管人发出回函。在限期内，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。

3、基金托管人发现基金管理人有关与《基金法》或其他相关法律、法规、基金合同和本协议禁止行为规定的重大违规行为时，应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。

### （二）基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

1、根据《基金法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否妥善保管基金的全部资产、是否按时进行赎回资金的转出、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入指定的账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同和其他有关证券法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应即时核对并以书面形式给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，督促托管人改正。

基金管理人发现基金托管人有与《基金法》或其他相关法律、法规、基金合同和本协议禁止行为规定的重大违规行为时，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### （三）基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

## 三、基金财产保管

### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金托管人依法持有并安全保管基金的全部财产。
- 2、基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的财产。托管人为基金设立独立的账户，本基金财产与托管人的其他财产及其他基金的财产实行严格的分账管理。
- 3、基金托管人应安全保管基金的全部财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

### （二）基金份额发售期间及成立时募集资金的验资

基金份额发售期间的资金应存于在基金托管人处开立的银行临时存款专用账户，该账户由基金管理人管理。

基金份额发售期满，由管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具验资报告应由参加验资的 2 名以上中国注册会计师签字有效。

基金成立后，基金管理人应将募集的全部资金存入基金托管人以基金名义开立的银行账户中。

### （三）基金银行账户的开设和管理

- 1、基金的银行账户的开设和管理由基金托管人负责。
- 2、基金托管人以基金的名义在其营业机构开设一个基本账户和多个基金清算专用账户，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设备付金账户，并根据基金管理人的指令办理资金收付。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，均需通过基金的银行账户进行。
- 3、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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何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《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

- 1、基金托管人以本基金的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司和中央国债登记结算公司开设证券账户。
- 2、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对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- 3、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券资金清算；在中央国债登记结算公司开立债券账户，用于国债的交易和清算。中央国债登记结算公司及基金托管人和基金管理人签定三方国债回购主协议。
- 4、资金账户管理与使用由托管人负责。
- 5、基金证券帐户的开立由基金托管人负责，管理由基金管理人负责。

### （五）基金同业拆借市场交易账户和国债托管账户的开设和管理

1、基金成立后，经中国证监会和中国人民银行批准，可申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人负责以基金名义在中央国债登记结算有限公司开设国债托管账户。

2、同业拆借市场交易账户和国债托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签定协议，进行使用和管理。

### （六）其他账户的开设和管理

其他账户可以根据基金合同，经有关部门批准后，由基金托管人负责以基金名义开立。新账户按有关规则使用并管理。

#### (七) 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人以基金名义存入中央国债登记结算公司、中国证券登记结算有限责任公司或其他的代保管库中。保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同，由基金管理人以基金的名义签署，合同原件由基金托管人保管。

### 四、基金资产净值计算与复核

#### (一) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数后的价值。

基金份额净值每日计算并公告一次。

估值程序和方法按照有关国家法律法规执行。

##### 2、复核程序

基金管理人每日对基金资产进行估值后，将估值结果发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人。

#### (二) 基金净值计算错误的责任

基金管理人为基金净值计算的责任人，因基金净值计算错误给投资人造成损失，基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成 10 元人民币以上的损失。

#### (三) 基金账册的建立和基金账册的定期核对

##### 1、账册的建立

基金会计核算由基金管理人承担，基金托管人也应按双方约定的同一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，用于对基金会计的复核。双方应指定经办基金的财务会计人员负责编制、保管基金的会计账册；双方管理或托管的不同基金的会计账册，应完全分开，单独编制和保管。

##### 2、凭证保管及核对

证券交易凭证由基金托管人和基金管理人分别保管并据此建账。每个交易日终了后至下一个交易日上午 9:00 前，基金管理人将当天的清算结果通过加密电脑发送给基金托管人。基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对，从而核对证券交易账目。

基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证，由基金托管人保管原件并记账，每周附指令回执和单据复印件交基金管理人记账。

基金管理人与基金托管人对基金账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人应及时查明原因和纠正，保持双方的账册记录完全相符。

#### (四) 基金财务报表的编制、复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表，由基金管理人和基金托管人按规定分别独立编制。

##### 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人公章，各留存一份。

##### 3、报表的编制与复核时间安排

月度报表每月终了后 5 个工作日内完成，其中管理人编制报表时间 3 个工作日，托管人复核报表时间 2 个工作日；年中报表为基金会计年度半年终了后 60 日内完成，其中管理人编制报表时间 40 日，托管人复核报表时间 20 日；年度报表为基金会计年度结束后 90 日内完成，其中管理人编制报表时间 60 日，托管人复核报表时间 30 日。

#### 五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册由基金托管人按照中国证监会的有关规定，向融通基金管理有限公司的注册登记机构取得，安全保管，并向中国证监会报送。

#### 六、争议的处理

因本协议产生的争议，双方当事人应尽量通过协商、调节途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，可向有管辖权的人民法院起诉，也可以在本托管协议的签订地的仲裁机构通过仲裁方式解决。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和托管人职责，各自继续勤勉、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。

#### 七、托管协议的修改和终止

(一) 本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

(二) 发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- 4、发生《基金法》规定的基金终止事项。

## 第二十一节 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，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) 资料寄送

##### 1、基金份额持有人对账单

我们将向持有人寄送的对账单包括季度对账单和年度对账单：在每个季度结束后的 10 个工作日内向当季有交易的持有人寄送开放式基金份额余额对账单、开放式基金交易明细表；在每年度结束后 15 个工作日内向所有持有人寄送开放式基金份额余额对账单、开放式基金交易明细表。

##### 2、电子邮件寄送

融通基金管理公司为投资者准备了“融通开放式基金运作双周报”、“证券市场特别报告”、“融通开放式基金月报”等多层次、多角度的系列投资理财刊物，以电子邮件形式向客户发送。另外，融通基金管理公司也将及时以电子邮件形式向投资者发送旗下基金分红公告等。

#### (二) 手机短信服务

融通基金管理公司将通过手机短信向基金份额持有人发送基金份额净值（需客户定制）、基金分红、节日问候等信息服务。您可以拨打 0755-26948088 转人工或通过网站留言留下手机号码，享受此便利服务。

#### (三) 在线服务

通过本公司网站，客户还可获得如下服务：

##### 1、查询服务

所有融通开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

## 2、信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资讯。

## 3、网上交易服务

截止本招募说明书公告日，凡持有兴业银行卡及带银联标志的部分银行卡的客户，均可通过基金管理人的网站登录网上直销系统进行开放式基金开户与交易（工商银行牡丹卡客户目前只能办理转换和赎回交易业务）。具体详情请查看公司网站或相关公告。

### （四）资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息

#### 1、可拨打融通基金管理有限公司客户服务热线：

0755-26948088

#### 2、登陆融通公司互联网站

公司网址：<http://www.rtfund.com>

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

## 第二十二节 其他应披露的事项

（一）2006 年 10 月 25 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通新蓝筹证券投资基金 2006 年第三季度报告》；

（二）2006 年 10 月 31 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《华龙证券有限责任公司办理融通开放式基金业务的公告》；

（三）2006 年 11 月 3 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通基金关于开通建行网上支付通道的公告》；

（四）2006 年 11 月 20 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通新蓝筹证券投资基金暂停接受大额申购和转入申请的公告》；

（五）2006 年 11 月 20 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通基金管理有限公司开通融通新蓝筹证券投资基金转换业务的公告》；

（六）2006 年 11 月 27 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《关于恢复融通新蓝筹证券投资基金申购和转入业务的公告》；

（七）2006 年 12 月 15 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通新蓝筹基金新增代销机构的公告》；

（八）2007 年 2 月 3 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告》；

（九）2007 年 2 月 5 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告》；

（十）2007 年 2 月 5 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《关于融通新蓝筹基金开通在中国建设银行的前端收费模式定期定额申购业务的公告》；

（十一）2007 年 3 月 16 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通新蓝筹证券投资基金第十次分红预告》；

（十二）2007 年 3 月 19 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《关于融通新蓝筹证券投资基金和融通动力先锋基金开通上海银行定期定额投资业务的公告》；

（十三）2007 年 3 月 20 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了

《融通新蓝筹证券投资基金第十次分红公告》；

(十四) 2007 年 3 月 27 日，我公司在中国证券报、上海证券报和证券时报上公告了《融通新蓝筹证券投资基金 2006 年年度报告摘要》

### 第二十三节 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

### 第二十四节 备查文件

- (一) 中国证监会核准融通新蓝筹证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值和其他临时公告等

上述备查文件存放在本基金管理人、基金托管人办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。

融通基金管理有限公司

2007年4月27日