

# **华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金**

## **更新的招募说明书**

二零零八年五月

## 重要提示

华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金于2004年3月24日获中国证监会证监基金字【2004】41号文批准募集，基金合同于2004年5月11日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2008年5月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年3月31日，数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的，以本次更新的招募说明书为准。

## 目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	12
五、相关服务机构.....	15
六、基金的募集.....	23
七、基金合同的生效.....	23
八、基金的申购与赎回.....	23
九、与基金管理人管理的其他基金转换.....	29
十、基金的投资.....	32
十一、基金的业绩.....	38
十二、基金的财产.....	39
十三、基金资产估值.....	40
十四、基金的收益与分配.....	45
十五、基金费用与税收.....	46
十六、基金的会计与审计.....	48
十七、基金的信息披露.....	49
十八、风险揭示.....	52
十九、基金的终止与清算.....	54
二十、基金合同摘要.....	56
二十一、基金托管协议摘要.....	66
二十二、对基金份额持有人的服务.....	73
二十三、其他应披露事项.....	74
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	75
二十五、备查文件.....	75

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）等有关法规及《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书依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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 招募说明书：**指《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日；
- 基金合同：**指《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
- 基金或本基金：**指依据基金合同所设立的华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金；
- 《证券法》：**指《中华人民共和国证券法》；
- 《基金法》：**指《中华人民共和国证券投资基金法》；
- 《运作办法》：**指《证券投资基金运作管理办法》；
- 《销售办法》：**指《证券投资基金销售管理办法》；
- 《信息披露办法》：**指《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；
- 中国银监会：**指中国银行业监督管理委员会；
- 基金管理人：**指华宝兴业基金管理有限公司；
- 基金托管人：**指中国建设银行股份有限公司；
- 基金销售代理人：**指具有开放式基金销售代理资格、依据有关《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金销售代理协议》办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构；
- 基金注册登记机构：**指基金管理人或接受基金管理人委托代为办理基金注册与过户登记业务的机构；
- 基金合同当事人：**指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人、基金份额持有人、基金注册登记机构；
- 基金份额持有人：**指根据基金合同合法取得本基金份额的个人投资者、机构投资者及合格的境外机构投资者（QFII）；
- 基金份额持有人大会：**由基金份额持有人及其合法授权代表按照基金合同之规定参加的会议；
- 独立董事：**指与基金管理人、基金托管人、基金份额持有人以及其他董事无关联关系的董事；

- 个人投资者：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资于基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的并依据有关法律、法规及其他有关规定可以投资于基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者：指符合国家有关法律法规规定的条件，经中国证监会批准，可投资于中国证券市场的境外机构；
- 投资人：指个人投资者、机构投资者以及合格境外机构投资者(QFII)；
- 基金合同生效日：指 2004 年 5 月 11 日；
- 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期；
- 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；
- T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
- 开放日：指基金管理人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- 认购：指在设立募集期内，基金投资人购买基金份额的行为；
- 申购：指基金存续期内，基金投资人购买基金份额的行为；
- 赎回：指基金存续期内，基金投资人卖出基金份额的行为；
- 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、基金的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；
- 基金账户：指基金注册登记机构给投资人开立的用于记录投资人持有本基金份额余额及其变动情况的账户；
- 基金资产总值：指基金所购买各类证券、银行存款本息和基金应收的申购款项以及其他投资所形成的价值总和；
- 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额资产净值：指每一基金份额的资产净值；
- 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资产净值的过程；
- 元：指人民币元；
- 基金销售网点：指基金管理人的直销中心和基金销售代理人的代销网点；

- 销售机构：指基金管理人和基金销售代理人；
- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行基金信息披露的报纸、互联网网站或其他媒体；
- 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、部门规章以及其他对合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；
- 不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署生效之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行本协议的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

办公地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

法定代表人：郑安国

总裁：裴长江

成立日期：2003 年 3 月 7 日

电话：(021) 50499588

传真：(021) 50499688

联系人：宋三江

注册资本：1.5 亿元

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东法国兴业资产管理有限公司持有 49% 的股份。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

郑安国先生，董事长、博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方

证券有限公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长。

Christian D' ALLEST 先生，董事，法学硕士。曾任法国兴业银行国际部业务经理、国际融资司经理、资本市场司负责人、资产管理司负责人。现任法国兴业资产管理有限公司国际部主任。

袁志刚先生，独立董事，博士、教授、博导。法国巴黎社会科学高等研究院(E. H. E. S. S.)经济学博士毕业，曾任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。现任复旦大学经济学院院长。

谢荣先生，独立董事，博士、教授。曾任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授，毕马威华振会计师事务所合伙人。现任上海国家会计学院副院长。

吴志攀先生，独立董事，法学博士、教授。曾任北京大学法律系讲师副教授、教授、博导，经济法教研室副主任、系主任，北京大学法学院院长，北京大学校长助理。现任北京大学副校长。

裴长江先生，董事，总裁，硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理，申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理，申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总裁。

陆云飞 (Denis LEFRANC) 先生，常务副总裁，文学士，法学士。曾任法国期货市场委员会审计员，法国兴业银行法律顾问，法国兴业银行资本市场及资产管理部副经理，BAREP 资产管理公司（法国兴业银行集团子公司）首席法律顾问，法国兴业资产管理有限公司首席法律顾问。现任华宝兴业基金管理有限公司常务副总裁。

陆舜华女士，监事、监事会召集人，现任法兴资产（香港）首席执行官。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任公司营运副总监。

詹靖女士，监事，女，金融学硕士，曾在 TCL 销售公司人力资源部、华宝信托投资有限责任公司业务管理部、基金筹备组、华宝兴业基金管理有限公司投资管理部工作，现在公司人力资源部工作。

## 2、本基金基金经理

牟旭东先生，经济学硕士，曾在南方证券有限公司担任行业研究部副经理，历任华宝兴业基金管理有限公司高级分析师、研究部副总经理、研究部总经理。2003 年 1 月加入本公司。2007 年 10 月开始担任多策略增长基金基金经理。



多策略增长基金的历任基金经理为童国林先生，任职时间为 2004 年 5 月至 2006 年 4 月。余荣权先生，任职时间为 2006 年 4 月至 2007 年 4 月。黄小坚先生，任职时间为 2006 年 9 月至 2007 年 10 月。

### 3、投资决策委员会成员

任志强先生，投资总监。

Gabriel Gondard 先生，投资副总监。

魏东先生，投资副总监、投资部总经理、宝康灵活配置基金基金经理、先进成长基金基金经理。

王旭巍先生，宝康债券基金。

雷勇先生，海外投资管理部总经理。

郭鹏飞先生，研究部副总经理。

### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 1、依法募集本基金，办理或者委托经中国证监会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、办理本基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

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

2、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》

的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》行为的发生。

3、基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

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。

5、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司自有资产、各项委托基金财产、其他资产分

离运作，独立进行；

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应地修改或完善。

## 2、内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

## 3、督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### 4、内控审计风险管理制度

内控审计风险管理部依据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，进行公正客观的检查和评价。

内控审计风险管理部负责调查、评价公司有关部门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；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；协助评价基金财产风险状况；负责公司主要领导离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

## 四、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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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 5003

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。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后建设银行的已发行股份总数为：

233,689,084,000 股（包括 224,689,084,000 股 H 股及 9,000,000,000 股 A 股）。截至 2007 年 9 月 30 日止，中国建设银行总资产达人民币 64,060.41 亿元，比上年末增加人民币 9,575.30 亿元，增长 17.57%；总负债人民币 60,161.19 亿元，比上年末增加人民币 8,978.12 亿元，增长 17.54%。客户贷款及垫款人民币 31,731.02 亿元，比上年末增加人民币 3,772.19 亿元，增长 13.49%；客户存款人民币 51,938.00 亿元，比上年末增加人民币 4,725.44 亿元，增长 10.01%。2007 年 1-9 月中国建设银行实现净利润人民币 571.01 亿元，每股收益为人民币 0.25 元。核心资本充足率为 10.60%，资本充足率为 12.53%。（备注：以上财务数据未经审计）

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、悉尼设有代表处。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，并于 2006 年 12 月 29 日完成收购交割，美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。中国建设银行被《环球金融》杂志评选为“亚洲最佳新兴市场银行奖-2007 年度中国最佳银行”，被《财资》杂志评选为“2007 年度最佳公司治理企业”，荣获《亚洲银行家》“中国房屋按揭贷款业务成就奖”。在《上海证券报》主办和北京大学光华管理学院提供学术支持的“2006 影响中国—上市公司系列评选”活动中，中国建设银行荣获“2006 最具影响力的中国海外上市公司”称号。在中国信息协会、亚洲客户服务协会等机构主办的“2006-2007 中国最佳客户服务”评选活动中，中国建设银行荣获“中国最佳客户服务奖”、“中国客户服务突出贡献荣誉奖”等奖项。

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、QFII/QDII 营运团队、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队等 11 个职能处室，现有员工 110 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 2007 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、

鸿飞、银丰等 8 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、银华一道琼斯 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、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹等 55 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，负责全行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；业务管理严格实行复核、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《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“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.每工作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，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手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，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、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。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）直销中心

本公司在上海开设直销中心。

地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

邮政编码：200121

直销中心电话：021-50499588-301、302

直销中心传真：021-50499663、50499667

##### （2）网上交易

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

#### 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务统一咨询电话：95533

银行网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 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

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

营业期限：持续经营

客服电话：95555

联系人：兰奇

电话：0755-83195834

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(4) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：吴杰

客户服务电话：95568

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

(5) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588



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

(6) 中信银行股份有限公司

24 小时客户服务热线：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(7) 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 25、24、10 层

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

法定代表人：马国强

客服电话：400-8888-555

电话：0755-82490000

联系人：范雪玲

公司网站：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(8) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676161

传真：021-38676161

联系人：芮敏祺

服务热线：400-8888-666；021-962588

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(9) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：肖时庆

联系人：李洋

电话：010-66568047

客户服务电话：800-820-1868

网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(10) 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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：400-8888-108(免长途费)

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

(11) 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、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：(020) 87555888 转各营业网点

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

(12) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：4008-888-999 或 027-85808318

联系人：李良

电话：021-63219781

传真：021-51062920

长江证券长网网址：<http://www.95579.com>

(13) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：021-962503

联系人：徐月

公司网址：www.htsec.com

(14) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943167

联系人：黄健

客户服务热线：4008881111、0755-26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(15) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

服务热线：021-962505

联系人：王序微

公司网址：www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

(16) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

联系人：杨盛芳

客户服务热线：021-68419974

公司网站：www.xyzq.com.cn

(17) 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：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人：王东明

电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：陈忠

公司网址：www.ecitic.com

(18) 国元证券有限责任公司

注册地址：合肥寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：(0551) 2634400

传真：(0551) 2626941

联系人：李蔡

客户服务热线：400888777（全国统一客户服务热线）

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

(19) 东吴证券有限责任公司

注册地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 号

办公地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 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

公司网站：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(20) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：王明权

电话：021-50818887

传真：021-68815009

联系人：刘晨

客户服务热线：10108998

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

(21) 平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：叶黎成

联系人：袁月

电话：0755-22627802

客户服务热线：95511

网站：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

(22) 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

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-50367888

传真：021-50366868

客户服务热线：021-962506

公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(23) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客户服务电话：96598

联系人：王勤

电话：0571-85783715

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

(24) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：林建闽

电话：0755-82130833-2181

传真：0755-82133302

客户服务热线：800-810-8868

国信证券网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(25) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路 316 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

客户咨询电话：0532-96577

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

(26) 华泰证券有限责任公司

住所：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-950、248

传真：025-84579763

联系人：李金龙、张小波

客户服务热线：025-84579897

公司网址：[WWW.HTSC.COM.CN](http://WWW.HTSC.COM.CN)

(27) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：唐新宇

咨询电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

传真：021-50372474

(28) 恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客户服务电话：0471-4961259

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

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

(二) 基金注册登记机构：华宝兴业基金管理有限公司（同上）

(三) 律师事务所和经办律师

名称：海华永泰律师事务所

住所：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 楼 7 层

办公地址：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 楼 7 层

负责人：颜学海

联系电话：021-58773177

传真：021-58773268

联系人：冯加庆

经办律师：冯加庆、李楠

#### (四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 61238888

传真：(021) 61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：肖峰 陈玲

## 六、基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字【2004】41号《关于同意华宝兴业多策略增长证券投资基金设立的批复》核准（核准日期2004年3月24日），由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从2004年3月31日起向社会公开发行，至2004年4月30日止，共募集5,233,338,344.60份基金份额，有效认购户数为115318户。

## 七、基金合同的生效

本基金基金合同于2004年5月11日正式生效。

## 八、基金的申购与赎回

### (一) 基金投资人范围

个人投资者、机构投资者（法律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外）及合格的境外机构投资者（QFII）。

### (二) 申购与赎回办理的场所

基金的申购和赎回将通过基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点进行。

本基金的销售机构包括华宝兴业基金管理有限公司及其委托的代销机构，目前的代销机构为中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、联合证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、国元证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东吴证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司和恒泰证券有限责任公司的代销网点。

华宝兴业基金管理有限公司可根据情况变更或增减基金销售代理人，并予以公告。

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。

条件成熟时，投资人可通过华宝兴业基金管理有限公司或者指定的基金销售代理人以电话或互联网等形式进行申购与赎回。

### （三）申购与赎回办理的时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的证券交易所交易日。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

申购赎回的时间根据招募说明书及其更新的招募说明书的规定执行。若出现新的证券市场、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具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购的开始时间及业务办理时间

本基金自 2004 年 6 月 18 日起开始办理日常申购业务。

#### 3、赎回的开始时间及业务办理时间

本基金自 2004 年 8 月 10 日起开始办理日常赎回业务。

### （四）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额资产净值



为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；

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

5、基金的申购与赎回申请以书面方式或经基金管理人认可的其他方式进行；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

#### （五）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，必须在其提出赎回申请的销售机构（网点）的交易账户内有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2工作日及之后通过本公司客户服务电话或到其提出申购、赎回申请的网点进行成交查询。

##### 3、申购和赎回的款项支付

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。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回款按有关规定自成交确认日起5个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### （六）申购与赎回的数额限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过代销网点申购的单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。

通过直销中心首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1000元人民币（含申购费）。已在直销中心有认购基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，

但受追加申购最低金额的限制。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

## 2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于100份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的程序和数额限制，但应最迟在调整生效前3个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

### (七)申购份数与赎回金额的计算方式

#### 1、申购份额的计算

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / [1 + \text{申购费率}]$$

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

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

申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

#### 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

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

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

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

3、T日的基金份额资产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。

### (八) 申购与赎回的注册登记

基金投资人提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

1、投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为投资人办理增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 工作日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资人赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

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个工作日予以公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）超过前一日基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 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，应当按单个基金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；投资人未能赎回部分，除投资人在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并将以下一个开放日的基金份额资产净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。投资人在提出赎回申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（3）当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，并说明有关处理方法。

（4）连续两日以上（含本数）发生巨额赎回或在一段时间内三次以上发生巨额赎回时，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；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，并应当在指定媒体上进行公告。

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资人的申购申请：

（1）不可抗力；

- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市；
- (3) 暂停估值；
- (4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- (6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资人。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- (1) 拒绝接受、暂停接受某笔或数笔申购申请；
- (2) 拒绝接受、暂停接受某个或数个工作日的全部申购申请；
- (3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或数个工作日的申购申请。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资人的赎回申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (3) 暂停估值；
- (4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

3、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接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

4、基金暂停申购、赎回，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额资产净值。

如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定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资产净值。

如果发生暂停的时间超过1天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前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资产净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一

次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额资产净值。

## 九、与基金管理人管理的其他基金转换

### （一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

### （二）基金转换受理场所

基金转换受理场所与基金份额申购、赎回申请的受理场所相同。

### （三）基金转换受理时间

本基金于 2005 年 4 月 8 日开始办理华宝兴业现金宝货币市场基金转入本基金的转换业务，于 2005 年 8 月 8 日开始办理华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金转入本基金和本基金转入华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金的转换业务。

本基金于 2006 年 9 月 15 日开始办理本公司管理的动力组合基金、收益增长基金与本基金间的转换业务。

本基金于 2007 年 1 月 4 日起在本公司直销中心和网上交易开放与先进成长基金的转换业务。

本基金于 2007 年 9 月 24 日开始办理本公司管理的行业精选基金与本基金间的转换业务。

本基金于 2007 年 12 月 6 日开始办理在招商银行开放宝康系列基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金和行业精选基金与本基金间的转换业务。

本基金于 2008 年 1 月 16 日开始办理在民生银行开放宝康系列基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金与本基金间的转换业务。

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。

### （四）基金转换费用

本基金与宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金之间转换：转换费率为 0.4%，25%转换费计入转出基金财产，其余用于注册登记等费用。

现金宝货币市场基金转换成本基金：投资人持有现金宝货币市场基金基金份额 90 个自然日以上（含 90 个自然日）的基金份额的转换费率为转出的基金金额申购转入基金所对应的申购费率的 80%。持有时间少于 90 个自然日的基金份额的转换费率为转出的基金金额申购转入基金所对应的申购费率。

本基金转换成现金宝货币市场基金：转换费率为 0.4%，其中转换费的 25% 计入转出基金财产，其余用于注册登记等费用。

本基金与动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金之间转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。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。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

#### （五）基金转换公式

1、基金转换公式为：

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

其中，

A 为转入基金的基金份额；

B 为转出基金的基金份额；

C 为转换当日转出基金的基金份额净值；

D 为转换费率；

E 为转换当日转入基金的基金份额净值。

转入份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。

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

（六）不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。

（七）基金转换的程序

1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

## 2、基金转换申请的确认

基金管理人以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

基金份额持有人申请转换时，基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先转换，后确认的份额后转换。

### （八）基金转换的数额限制

基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位。从本基金、宝康系列基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金转出，单笔转换申请份额不得低于 100 份；从现金宝货币市场基金转出，单笔转换申请份额不得低于 1000 份。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构（网点）保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，注册登记机构不作强制赎回处理。

### （九）基金转换的注册登记

1、基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间内可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、基金注册登记机构在 T+1 日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

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

### （十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

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

- （1）不可抗力；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市；
- （3）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；
- （4）暂停估值；
- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、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拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报中国证监会备案。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。

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信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股，在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。

### （二）投资范围和对象

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资对象按流通市值和市净率分为四大股票风格板块：大盘价值、大盘成长、中小盘价值、中小盘成长。80%以上的股票资产投资于符合各风格板块精选个股标准的股票。

### （三）投资理念

风格转换及个股精选策略能够有效控制风险，创造超额收益。

### （四）投资策略

本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会，注重资产在各风格板块间的配置，同时在各风格板块内部精选个股。

在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%—95%；债券为 0%—45%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5% 以上。

#### 1、股票投资策略

##### （1）风格板块轮动策略



根据数量化辅助模型和公司内部研究支持以及基金经理自身判断，决定股票资产在各风格板块间的配置。当某一风格板块相对大市的超额收益率出现上升或者下降趋势并到达预设的临界点时，我们增加或者减少该板块的权重。

## (2) 风格板块的股票精选策略

针对各风格板块，有不同的板块内精选个股标准，定性指标与定量指标相结合，定性指标主要考察上市公司的治理结构、管理水平、竞争优势及行业特点等因素。

1) 大盘价值板块：采用股息率、市盈率、市净率、市销率、市现率五个指标。股息率较高的股票得分较高，市盈率、市净率、市销率、市现率较低的股票得分也较高。

2) 大盘成长板块：我们侧重于选取具有难以超越的竞争优势的个股。主要考虑公司是否具有优越的管理团队，具有长期发展策略；具有垄断优势；公司所处行业基本面已经好转，且已有融资计划的上市公司；所在行业中处于领先地位，或者占据绝对多数的市场份额；高收益增长率，高利润率；专利产品多，低成本的生产或/或分销能力。

3) 中小盘价值：我们侧重选取内在价值被市场低估的个股。具体的评价指标是股票被低于其清算价值或其有形帐面价值出售；相对于其获益潜力或者重置成本来说，股票价格偏低；公司进行资产重组，股票价格大大低于市场估值；公司具有至少 10-20% 的增长率，财务状况良好，市盈率低于市场平均水平。

4) 中小盘成长：我们倾向于选择业绩可能大幅增长、股本扩张能力强的上市公司的个股。主要考虑过往盈利持续增长或盈利增长潜力巨大；获取具有吸引力的净资产收益率（ROE）的能力；低于基金经理对未来三年预期盈利增长率的 P/E 指标；不断扩大的市场份额；良好的资产负债情况；股东及管理团队实力雄厚；较强的新产品开发能力。

## 2、债券投资策略

(1) 本基金定位为股票型基金；在政策允许的情况下，本基金债券投资的下限为零；

(2) 本基金债券投资的主要目的是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险，同时能够获取债券投资的收益；

(3) 本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

## 3、权证投资策略

本基金具备投资权证的条件。我公司在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

### (五) 业绩比较基准

80%×复合指数+20%×上证国债指数。其中，

$$\text{复合指数} = \frac{\text{上证 180 流通市值}}{\text{成分指数总流通市值}} \times \text{上证 180 指数} + \frac{\text{深证 100 流通市值}}{\text{成分指数总流通市值}} \times \text{深证 100 指数}$$

成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深证 100 流通市值

### (六) 投资程序

1、公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下，基金经理小组综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断，按照基金的合同规定，提出下一阶段本基金类属资产配置比例。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略，审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议，参考本公司研究部和其他机构的研究报告，选择具体的投资目标，构建投资组合。

5、设置独立的中央交易室，基金经理将投资指令下达给中央交易室，交易主管在复核投资指令合法合规的基础上，将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分隔。

6、内部控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控，内控审计风险管理部对基金投资过程进行日常监督，出具风险报告。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

### (七) 基金的禁止行为

- 1、投资于其他基金；
- 2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、动用银行信贷资金从事证券买卖；
- 4、将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、以基金财产进行房地产投资；
- 7、从事有可能使基金承担无限责任的投资；
- 8、将基金财产投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

- 9、违反证券交易业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；
- 10、进行高位接盘、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为；
- 11、通过股票投资取得对上市公司的控制权；
- 12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法利益；
- 13、法律、法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

#### （八）基金投资组合比例限制

- 1、基金持有的股票、债券比例不低于基金资产总值的 80%；
- 2、基金持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- 3、基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- 4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。

- 5、我公司运用基金财产进行权证投资时，将严格参照证监会的有关规定，进行管理和控制：

（1）一只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千分之五；

（2）一只基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

（3）本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的，不受上述（1）、（2）、（3）项规定的比例限制。

因证券市场波动、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上述（2）、（3）项及基金合同或基金权证投资方案约定的投资比例的，本公司将在十个交易日内调整完毕。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 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、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

#### （十）基金的融资

基金可以按照国家有关规定进行融资。

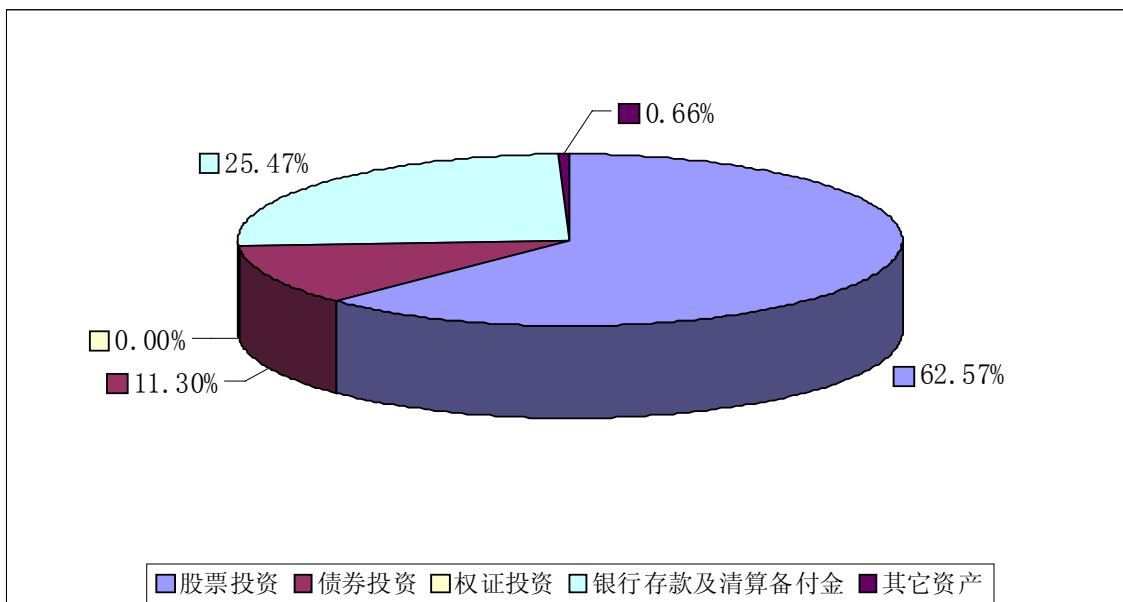
(十一) 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2008 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合

截至2008年3月31日，本基金资产组合列表及图示如下：

类别	合计（元）	占基金总资产比例
股票投资	4,932,725,459.19	62.57%
债券投资	890,522,792.20	11.30%
权证投资	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金	2,008,106,436.52	25.47%
其它资产	51,799,688.41	0.66%
合计	7,883,154,376.32	100.00%



2、按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值（元）	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	5,993,183.81	0.08%
2	采掘业	184,371,177.17	2.37%
3	制造业	2,458,546,821.88	31.60%
	其中：食品、饮料	184,040,834.69	2.37%
	纺织、服装、皮毛	50,958,476.78	0.65%
	木材、家具	0.00	0.00%
	造纸、印刷	34,503,780.59	0.44%
	石油、化学、塑胶、塑料	895,298,247.39	11.51%
	电子	45,431,010.42	0.58%
	金属、非金属	578,028,224.65	7.43%
	机械、设备、仪表	323,323,464.27	4.16%
	医药、生物制品	322,914,457.23	4.15%
	其他制造业	24,048,325.86	0.31%

4	电力、煤气及水的生产和供应业	243,114,203.10	3.12%
5	建筑业	39,038,604.00	0.50%
6	交通运输、仓储业	145,994,484.64	1.88%
7	信息技术业	383,390,517.50	4.93%
8	批发和零售贸易	376,785,197.56	4.84%
9	金融、保险业	597,907,652.47	7.68%
10	房地产业	386,714,050.64	4.97%
11	社会服务业	286,687.50	0.00%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	110,582,878.92	1.42%
	合计	4,932,725,459.19	63.40%

## 3、基金投资前 10 名股票明细

序号	代码	名称	股票数量(股)	期末市值(元)	市值占基金净值比例
1	600588	用友软件	6,721,483	377,142,411.13	4.8472%
2	600036	招商银行	10,089,887	324,591,664.79	4.1718%
3	002001	新和成	8,824,332	317,675,952.00	4.0829%
4	600900	长江电力	17,303,502	243,114,203.10	3.1246%
5	601398	工商银行	26,779,436	164,157,942.68	2.1098%
6	600201	金宇集团	11,614,787	147,856,238.51	1.9003%
7	000002	万科A	5,200,000	133,120,000.00	1.7109%
8	600830	大红鹰	7,667,463	129,120,076.92	1.6595%
9	000402	金融街	5,400,000	124,146,000.00	1.5956%
10	601006	大秦铁路	7,108,176	122,971,444.80	1.5805%

## 4、按券种分类的债券投资组合

序号	债券种类	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	875,615,000.00	11.2539%
2	金融债券	0.00	0.0000%
3	企业债券	14,907,792.20	0.1916%
4	可转换债券	0.00	0.0000%
	合计	890,522,792.20	11.4455%

## 5、基金债券投资前 5 名明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	08 央行票据 30	347,095,000.00	4.4611%
2	08 央行票据 34	288,270,000.00	3.7050%
3	08 央行票据 16	240,250,000.00	3.0878%
4	08 上港债	8,130,226.50	0.1045%
5	08 中远债	3,397,813.00	0.0437%

## 6、基金资产支持证券投资前 10 名明细

本报告期内本基金未发生资产支持证券投资，特此报告。

## 7、投资组合报告附注

(1) 基金管理人没有发现本基金投资的前 10 名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

(2) 本基金股票投资对象为上海和深圳两个交易所上市交易，并符合基金投资策略规定的各风格板块选股标准的股票，没有特定的备选股票库。

(3) 本基金投资组合中其他资产包括：存出保证金 2,146,746.88 元、证券清算款 9,612,670.11 元、应收利息 2,855,919.20 元、应收申购款 37,184,352.22 元。

(4) 本基金在本报告期内未持有在转股期内的可转换债券。

(5) 本基金在本报告期内获得的权证明细如下：

a. 股权分置改革被动持有：无。

b. 主动投资：

权证代码	权证名称	数量(份)	成本(元)
580018	中远 CWB1	218,638.00	1,125,854.52
580020	上港 CWB1	1,106,343.00	1,647,123.46
总计		1,324,981.00	2,772,977.98

本报告期末本基金的权证投资市值为 0.00 元。

(6) 基金管理人于 2008 年 3 月 3 日通过代销机构申购本基金 402,500 元，申购费率为 1.5%。基金管理人按照有关规定于 2008 年 2 月 28 日进行了公开披露。

## 十一、基金的业绩

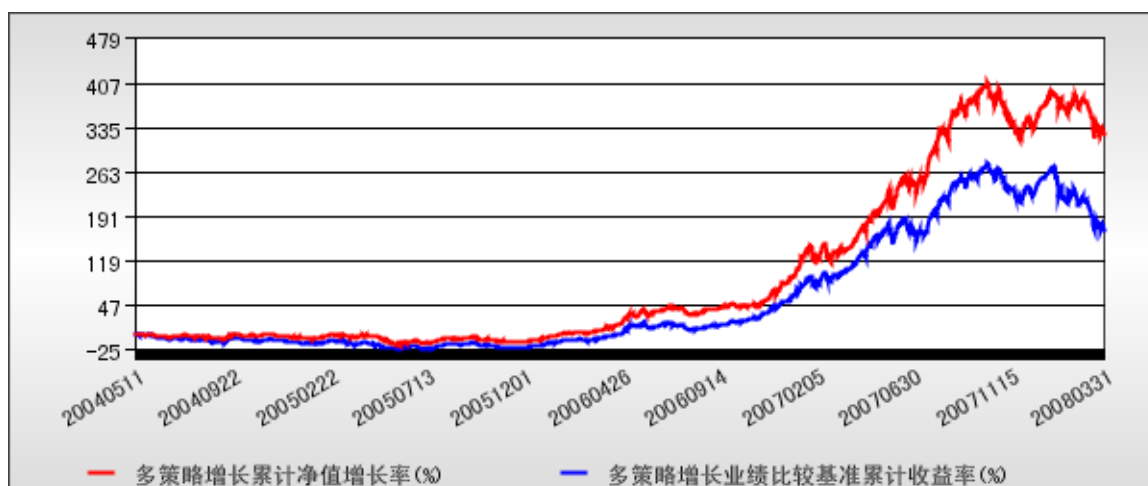
基金业绩截止日为 2008 年 3 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

## 1、净值增长率与同期比较基准收益率比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①-③	②-④
2004/05/11-2004/12/31	-3.26%	0.78%	-12.24%	1.08%	8.98%	-0.29%
2005/01/01-2005/12/31	-1.84%	1.06%	-3.62%	1.08%	1.78%	-0.02%

2006/01/01-2006/12/31	106.10%	1.21%	92.16%	1.13%	13.94%	0.08%
2007/01/01-2007/12/31	138.71%	1.98%	117.16%	1.84%	21.55%	0.14%
2004/05/11-2008/3/31	323.87%	1.40%	170.97%	1.43%	152.90%	-0.03%

2、基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比



按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2004年11月11日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 十二、基金的财产

### （一）基金财产的构成

基金资产总值是指基金所购买各类证券、银行存款本息和基金应收的申购款项以及其他投资所形成的价值总和。包括：

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

7、其他投资及其估值调整；

8、其他资产等。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

基金财产以本基金的名义开立基金专用银行存款账户，以托管人和基金联合名义的方式开立证券账户，上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的保管与处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。

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。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十三、基金资产估值

(一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

(二) 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：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌



的同一股票的市价估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(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。

## 2、债券估值方法：

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

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

(3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(5)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(5)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)–(5)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，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值方法：

(1)基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)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；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

5、根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四)估值程序

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (五)估值错误的处理

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、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错

遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1)差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1)查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4)根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (六)暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它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、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；

4、中国证监会认定的其它情形。

### (七)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### (八)特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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。

## 十四、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、已实现的其他合法收入、持有期间产生的公允价值变动及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

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等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于已实现基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配采用现金方式，投资人可选择获取现金分红或者将现金红利按红利发放日前一日的基金份额资产净值自动转为基金份额进行再投资（下称“红利再投资”）；默认收益分配方式为现金分红；
- 3、同一基金份额享有同等分配权；
- 4、基金收益分配后每基金份额资产净值不能低于面值；
- 5、如果基金投资当期出现亏损，则基金不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，当年基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；
- 7、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中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、分配方式及有关手续费等内容。

#### （四）收益分配方案的确定、公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后5个工作日内由基金管理人公告。

#### （五）收益分配中发生的费用

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，注册登记机构自动将基金份额持有人的现金红利按红利发放日前一日的基金份额资产净值转为相应的基金份额。

## 十五、基金费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、费用的种类

- （1）基金管理人的管理费（简称“管理费”）；
- （2）基金托管人的托管费（简称“托管费”）；
- （3）基金合同生效后的信息披露费用；
- （4）基金份额持有人大会费用；
- （5）基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）按照国家有关规定和基金合同规定可以列入的其他费用；

上述基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率（1.5%）计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金的基金托管费按前一日基金资产净值的年费率（0.25%）计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）本章第（一）节第1条第（3）至第（7）项费用由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，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金运作费用的项目

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

### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况，根据基金合同，调整基金管理费率和基金托管费率。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、基金的申购费

本基金的申购费率表如下：

500万（含）以上	1000元
大于等于200万，小于500万	申购金额的0.5%
大于等于100万，小于200万	申购金额的1.0%
大于等于50万，小于100万	申购金额的1.2%
50万以下	申购金额的1.5%

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。

申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

### 2、基金的赎回费

赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	费率
------	----

730 天以下	0.5%
730 天以上（含）	0.3%

赎回费用由赎回人承担，其中 25% 归基金资产，其余部分归注册登记机构。

3、基金管理人可自行降低申购、赎回费率；提高费率应召开基金份额持有人大会审议。最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。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指定媒体予以公告。

#### 4、基金转换费用

本基金与宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金之间转换：转换费率为 0.4%，25% 转换费计入转出基金财产，其余用于注册登记等费用。

现金宝货币市场基金转换成本基金：投资人持有现金宝货币市场基金基金份额 90 个自然日以上（含 90 个自然日）的基金份额的转换费率为转出的基金金额申购转入基金所对应的申购费率的 80%。持有时间少于 90 个自然日的基金份额的转换费率为转出的基金金额申购转入基金所对应的申购费率。

本基金转换成现金宝货币市场基金：转换费率为 0.4%，其中转换费的 25% 计入转出基金财产，其余用于注册登记等费用。

本基金与动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金之间转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。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。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

#### （三）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1、基金管理人为基金的基金会计责任方；



- 2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、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基金会计账目、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。

## （二）基金年度审计

1、本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。普华永道中天会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须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，报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后在五日内公告。

## 十七、基金的信息披露

### （一）披露原则

基金的信息披露将严格按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将至少在中国证监会指定的一种媒体上公告。

### （二）招募说明书

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的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。更新的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后一日。

### （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

### （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

### （四）基金份额净值和基金份额累计净值

基金管理人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。

### （五）定期报告

定期报告包括基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告。

1、基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

### （五）临时报告与公告

1、在基金运作过程中发生如下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时，有关信息披露义务人应当在2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；

2、转换基金运作方式；

3、基金管理人或基金托管人变更；

4、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

5、基金管理人股东及其出资比例发生变更；

6、基金募集期延长；

7、基金管理人或基金托管人基金托管部门的主要业务人员一年内变动超过30%以上；

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、基金所投资证券的债务人出现可能导致不能兑付的重大事件；
- 11、重大关联交易事项；
- 12、本基金开始办理申购、赎回；
- 13、基金发生巨额赎回并顺延支付；
- 14、暂停申购、赎回或转换；
- 15、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 16、暂停申购、赎回或转换结束重新开放申购、赎回或转换；
- 17、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 18、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 19、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；
- 20、提前终止基金合同；
- 21、基金收益分配事项；
- 22、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 23、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 24、基金改聘会计师事务所；
- 25、变更基金份额发售机构；
- 26、基金更换注册登记机构；
- 27、其他重大事项。

#### （六）澄清公告与说明

在任何公共媒介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，相关的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送中国证监会。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、招募说明书等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人处。投资人可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 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，将对本基金财产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响基金收益。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，从而对基金收益产生影响。

##### （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、财务因素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财产保值增值，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，从而影响基金财产的保值增值。

#### 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，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金财产损失和收益变化。

#### 3、投资风险

本基金存在各风格板块间配置和品种选择的风险，会受到所投资证券表现的影响。股票市场波动性比较大，股票上市公司的业绩也难以预计，这些都会反映到股票价格的涨跌上，从而给投资人带来风险。债券尤其是国债的表现相对稳定，但同样会受到诸如宏观经济、政策以及市场本身的影响而造成债券价格变动，企业债和金融债的投资还会受到债券本身信用评级变化的影响，这些都会给投资人带来收益变动的风险。

权证是金融衍生品的一种，具有高杠杆、高风险、高收益的特征，风险较大。

#### 4、流动性风险

开放式基金要随时应对投资人的赎回，如果基金财产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时对基金净值产生不利的影 响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金财产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额资产净值。

#### 5、各风格板块的配置及精选投资个股的风险

当本基金依据有关分析增加持有某一风格板块时，由于市场等方面因素可能导致短期内该板块预期超额收益率下降。另外，本基金也可能因为研究失误而选股不当，生成无效资产甚至带来损失。

#### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人 对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

#### 7、操作或技术风险

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人的利益受到影响。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。

#### 8、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。

#### 9、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，可能导致基金财 产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力 之外的风险，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股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、联合证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、

中信建投证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、汉唐证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、东吴证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、中信锦通证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司和恒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。

## 十九、基金的终止与清算

### （一）基金合同终止的情形和处理方式

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、在基金的存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或基金资产净值连续 60 个工作日低于人民币 5000 万元，报经中国证监会批准后，基金管理人将宣布本基金终止；
- 2、持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，本基金被中国证监会责令终止的；
- 4、基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而无其他托管机构承受其原有权利及义务；
- 5、由于投资方向变更引起的基金撤销；
- 6、中国证监会允许的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬，从基金财产中获得补偿的权利时，可以留置基金财产或者对基金财产的权利归属人提出请求。

### （二）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

(2) 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。基金财产清算小组在成立后五个工作日内应当公告。

(3) 基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

## 2、基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (5) 公布基金财产清算公告；
- (6) 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小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小组优先从基金财产中支付。

## 4、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)至(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

基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会批准后3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、基金合同摘要

### （一）基金份额持有人的权利和义务

#### 1、基金份额持有人权利：每份基金份额具有同等的合法权益

（1）按基金合同的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，就审议事项行使表决权；

（2）按基金合同的规定取得基金收益；

（3）监督基金经营情况，查询或获取公开的基金业务及财务状况的资料；

（4）赎回、申请基金转托管并在规定的时间取得有效申请的款项或基金份额；

（5）获取基金财产清算后的剩余财产；

（6）依照基金合同的规定，提议召开或召集基金份额持有人大会；

（7）拥有由于基金管理人、托管人、销售机构、注册登记机构的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；

（8）要求基金管理人或基金托管人及时行使法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的义务；

（9）法律、法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件规定的其他权利。

#### 2、基金份额持有人义务

（1）遵守基金合同；

（2）缴纳基金认购、申购和赎回等事宜涉及的款项及规定的费用；

（3）以其对基金的投资额为限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本基金其他当事人利益的活动；

（5）法律、法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### （二）基金管理人的权利和义务

#### 1、基金管理人的权利

（1）自基金合同生效之日起，基金管理人依照有关法律法规独立管理基金财产；

（2）根据基金合同的规定，制订、调整并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（3）根据基金合同的规定获得基金管理费，收取或委托收取投资人认购费、申购费、赎回费及其他事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的费用；

（4）在符合有关法律法规的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式，但基金合同规定应由持有人大会批准的，从其规定；



- (5) 根据基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 采取所有必要措施对基金托管人违反法律法规、基金合同和《托管协议》的行为进行纠正和补救；
- (7) 依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同或国家有关法律规定对基金财产、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和中国银监会，并有权向有关部门和基金份额持有人大会提议更换托管人，以及采取其他必要措施以保护基金及相关当事人的利益；
- (8) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (9) 选择、更换基金销售代理人。基金管理人可根据基金合同的有关规定选择适当的基金代销机构并有权依照销售代理协议对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查。如果基金管理人认为基金销售代理人的行为违反了法律法规、基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，包括但不限于停止、终止销售代理协议的执行，更换销售代理人，以保护基金财产的安全和相关当事人的利益；
- (10) 选择、更换注册登记代理机构，并对注册登记代理机构代理行为进行必要的监督和检查；
- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (12) 以基金的名义依法为基金进行融资；
- (13) 按照《基金法》及其他法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利；
- (14) 法律、法规基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- (1) 基金管理人应遵守《基金法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；
  - (2) 基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，管理和运用基金财产；
  - (3) 充分考虑本基金的特点，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财产，防范和减少风险；
- 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合格机构代为办理；
- 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与过户登记工作或委托其他机构代理该项业务；

(4) 建立健全内部控制制度, 保证基金管理人的固有财产和受托管理财产相互独立, 确保分别管理、分别核算、记账; 保证本基金与基金管理人管理的其他基金在资产运作、财务管理等方面相互独立, 确保分别管理、分别记账;

(5) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不为自己及任何第三方谋取利益; 基金管理人违反此义务, 利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益, 所得利益归于基金财产, 造成基金财产损失的, 承担赔偿责任;

基金管理人不得擅自将基金财产转为其固有财产, 违背此款规定的, 将承担相应的责任, 包括但不限于恢复基金财产的原状、承担赔偿责任;

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 基金管理人不得委托第三人管理、运作基金财产;

(7) 基金管理人违背管理职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失, 以其自有财产承担;

(8) 接受基金份额持有人、基金份额持有人大会、基金托管人依照基金合同及相关法律法规对管理人履行基金合同情况进行监督;

(9) 按规定计算并公告基金资产净值和基金份额资产净值;

(10) 按照法律和基金合同的规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(11) 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;

(12) 保守基金的商业秘密, 不泄露基金投资计划等; 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, 不向他人泄露, 但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金管理人违反基金合同规定的保密义务;

(13) 依据基金合同规定制订基金收益分配方案, 并向基金的持有人分配基金收益;

(14) 不谋求对基金财产所投资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, 执行基金份额持有人大会决议;

(16) 编制基金的财务会计报告; 保存基金的会计账册、报表及其他处理有关基金事务的完整记录 15 年以上;

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

(18) 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;

(19) 基金托管人因过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

(20) 基金管理人因违反基金合同规定的目的处分基金财产或者因违背基金合同规定的管理职责、处理基金事务不当而致使基金财产受到损失的，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(21) 确保向基金份额持有人和基金份额持有人大会提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(22) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(23) 法律、法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利和义务

#### 1、基金托管人的权利

(1) 依法持有并保管基金财产；

(2) 依据基金合同规定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人认为基金管理人违反基金合同或有关法律法规的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益；必要时可向有关部门、持有人大会提议更换基金管理人；

(4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(5) 法律、法规及基金合同规定的其他权利。

#### 2、基金托管人的义务

(1) 基金托管人应遵守基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，持有并保管基金财产；

(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；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险；

(3) 建立健全内部控制制度，确保基金财产的安全，保证本基金财产与基金托管人自有资产相互独立，保证本基金财产与基金托管人托管的其他基金财产相互独立；对本基金设置独立账户，独立核算，保证本基金名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面的独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产，造成基金财产损失的，承担赔偿责任；

基金托管人不得擅自将任何基金财产转为其固有财产，违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复所涉及的基金财产的原状、承担赔偿责任；

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

(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) 以托管人和基金联名的方式设立证券账户，以基金的名义开设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，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(8) 对基金商业秘密和基金份额持有人、投资人进行基金交易有关情况负有保密义务，不泄露基金投资计划、投资意向及基金投资人、基金份额持有人的相关情况资料等；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予以保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金托管人违反基金合同规定的保密义务；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额资产净值；

(10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；

(11) 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回和转换等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

(12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回、转换和注销价格的方法符合法律法规和基金合同等法律文件的规定；

(13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等有关法律文件的规定；

(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) 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，执行基金份额持有人大会决议；

(16) 按有关规定，保存基金的持有人名册、会计账册、报表和其他有关基金托管事务的完整记录等 15 年以上；

(17) 按规定制作相关账册并及时与基金管理人核对；

(18) 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；

- (19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 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银监会，并通知基金管理人；
- (21) 监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务；基金管理人因过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
- (22) 因过错导致基金财产的损失，应当承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (23) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- (24) 法律、法规、基金合同和依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

##### 1、召开事由

(1) 有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- 2) 与其他基金合并或变更基金类型；
- 3) 决定终止本基金；
- 4) 更换基金管理人；
- 5) 更换基金托管人；
- 6) 单独或合计持有本基金 10%（不含 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）书面要求召开基金份额持有人大会；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 8) 基金管理人或基金托管人就涉及本基金的事宜要求召开基金份额持有人大会；
- 9) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 以下情况不需召开基金份额持有人大会：

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

##### 2、召集方式

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会

时间及地点由基金管理人选择确定。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

(4) 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，基金份额持有人有权自行召集，但至少提前三十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。

### 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在中国证监会指定的至少一种报刊上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (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；
- (6) 如采用通讯表决方式，则载明投票表决的截止日以及表决票的送达地址；

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

#### 4、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人的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。

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；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。

召开基金份额持有人大会时，须满足以下条件：

（1）现场开会同时符合以下条件时，可以进行持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%。

（2）在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取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持有的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%；

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表提交的持有基金份额的凭证符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

#### 5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容为关系全体基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前 10 天公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基

基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。召集人对于基金管理人和基金托管人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

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

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。

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，大会召集人可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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，需由单独或合并持有权利登记日基金总份额 15%（不含 15%）以上的基金份额持有人提交；基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。

## （2）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会审核或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会审核或备案后生效。

（3）持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 6、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

对于一般决议须经本基金出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%（不含 50%）以上通过方为有效；



## 2) 特别决议

对于特别决议须参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上的基金份额持有人或其代理人通过方为有效；

更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止本基金等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人担任监票人。

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

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

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

### (2) 通讯方式开会

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

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自通过之日五日内由召集人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。

除非另有约定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 5 个工作日内在指定媒体公告。

(五) 基金合同解除和终止的事由、程序

有下列情形之一的，本基金经中国证监会核准后将终止：

- (1) 在基金的存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或基金资产净值连续 60 个工作日低于人民币 5000 万元，报经中国证监会批准后，基金管理人将宣布本基金终止；
- (2) 基金份额持有人大会表决终止的；
- (3) 因重大违法、违规行为，本基金被中国证监会责令终止的；
- (4) 基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而无其他托管机构承受其原有权利及义务；
- (5) 由于投资方向变更引起的基金撤销；
- (6) 中国证监会允许的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬，从基金财产中获得补偿的权利时，可以留置基金财产或者对基金财产的权利归属人提出请求。

(六) 争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商或调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，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。仲裁地点是上海。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

基金合同受中国法律管辖。

(七) 基金合同存放地核投资人取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人处。投资人可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

## 二十一、基金托管协议摘要

(一) 托管协议当事人

## 1、基金管理人

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦48楼

邮政编码：200121

法定代表人：郑安国

成立日期：2003年3月7日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19号

注册资本：1.5亿元人民币

经营范围：在中国境内从事基金管理、发起设立基金；中国证监会批准的其他业务。

组织形式：中外合资经营

营业期限：持续经营

## 2、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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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委员会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

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

##### (1) 监督和检查内容

根据《基金法》、基金合同及其他有关规定，对本基金的投资对象、基金财产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金的申购、赎回与基金收益分配等行为的合规性、合法性进行监督和核查。

## （2）处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同及其他有关规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函（如投资组合比例违规应于当日或次日回函，其他情况应于三个工作日内回函），说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对要求事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿基金因此所遭受的损失。

（3）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，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。

## 2、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

### （1）监督和检查内容

根据《基金法》、基金合同及其它有关规定，基金管理人对基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否擅自动用基金财产、是否按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金财产实行分账管理等行为进行监督和核查。

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

### （2）处理方式和程序

基金管理人发现基金托管人违反《基金法》、基金合同及其他有关规定的行为，应及时以书面形式要求基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对，并于三个工作日内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要求事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人

应报告中国证监会。

(3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，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。

### 3、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。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

## (三) 基金财产的保管

### 1、基金资产保管的原则

(1) 本基金所有资产的保管责任，由基金托管人承担。

基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

(2) 基金托管人应安全、完整地保管基金的全部资产；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

(3) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

(4) 对于基金申（认）购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关方确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关人追偿基金的损失。

(5) 基金托管人应及时、完整地执行基金管理人的各项正当指令。因未及时执行指令对基金或基金管理人造成的损失由基金托管人承担，不可抗力除外。

### 2、基金设立募集期间及募集资金的验资

(1) 基金设立募集期满，基金发起人应将设立募集的全部资金存入基金的临时验资专户；该验资账户由基金发起人根据中国证监会的批文开立；由基金发起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。出具的验资报告由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金发起人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人以基金名义开立的基金银行账户中，基金托管人在收到资金当日应出具书面确认。

(3) 验资报告出具后，基金成立。若基金未达到规定的募集额度不能成立，按规定办理退款事宜。

### 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金银行账户的开立和管理由基金托管人承担。

(2) 本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用，基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法指令办理资金收付。

(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) 基金银行账户的开立和管理应符合国家银行监管机构的有关规定。

### 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人负责以托管人和基金联合名义分别在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立证券账户。

(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。基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

### 5、国债托管专户的开立和管理

(1) 基金成立后，由基金管理人向基金托管人提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金托管人代理本基金在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，

并由基金托管人代本基金进行银行间市场债券的结算。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

#### 6、其它账户的开立和管理

(1) 因业务需要开立的其它账户,可以根据《基金契约》或有关法律法规的规定,凭基金管理人指令由基金托管人以基金名义开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

#### 7、证券账户卡保管

证券账户卡由基金托管人保管原件。

#### 8、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放,但要与非本基金的其他实物证券分开保管;也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司及其他有权保管机构的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 9、与基金资产有关的重大合同的保管

(1) 基金管理人代表基金签署并保管基金投资运作中的各类合同,基金管理人签署相关业务合同后应及时通知基金托管人。

(2) 基金管理人或基金托管人代表基金签署除基金投资运作外的但与基金资产有关的合同时,应通知对方并得到对方书面认可后方可签署。除基金投资运作外的与基金资产有关的合同由基金托管人保管。

#### (四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指本基金资产总值减去按照国家有关规定可以在该基金资产中扣除的费用后的价值。

2、基金管理人和基金托管人均应每日对基金资产估值。

3、基金资产净值和基金份额资产净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。

4、基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发

送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金资产净值予以公布。

5、根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，由注册登记机构负责编制并保管。

#### （六）争议解决方式

1、因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，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。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

2、争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

3、本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改与终止

1、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，报中国证监会备案后生效，须经批准的报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其它事由造成本基金更换基金托管人；
- （3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其它事由造成本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、基金合同或其它法律法规规定的终止事项。



## 二十二、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、基金投资人对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单每季度提供，在每季结束后的15个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单在每年度结束后1个月内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

#### 2、其他相关的信息资料

管理人以说明或电子形式向投资人寄送基金其他信息资料。

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，基金注册登记机构将其所获红利按分红实施日的基金份额资产净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以选择和更改基金分红方式。目前，本基金的默认分红方式已由红利再投资修改为现金分红。

### （三）定期定额投资计划

#### 1、定义

本基金的“定期定额投资计划”是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。“定期定额投资计划”不受“申购金额不低于人民币1,000元”的限制。

#### 2、适用投资人范围

本基金的“定期定额投资计划”仅适用于个人投资者。

#### 3、扣款金额限定

投资人在中国建设银行和招商银行的每期扣款金额最低不少于人民币300元（含申购费）；投资人在中国工商银行的每期扣款金额最低不少于人民币200元（含申购费）。

#### 4、办理场所

投资人可在中国建设银行、招商银行、中国工商银行下属各代销网点办理本基金的“定期定额投资计划”，其中，中国建设银行只接受个人投资者的申请。

待条件成熟时，本公司还将选择其他销售机构开办此业务。

## 5、办理方式

(1) 凡申请办理本基金“定期定额投资计划”的投资人须首先开立华宝兴业基金管理有限公司开放式基金基金账户，具体开户程序请遵循本基金销售机构规定；

(2) 投资人可携带本人有效身份证件、本人指定资金账户卡到本基金指定的销售机构网点柜面申请办理本基金的“定期定额投资计划”，具体办理程序请遵循该销售机构的规定。

## 6、撤销方式

投资人办理“定期定额投资计划”的撤销，须按照销售机构的要求携带相关材料到指定基金销售网点柜面提出申请。

### (四) 在线服务

基金管理人利用自己的网站（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）为基金投资人提供与基金经理（或投资顾问）的定期在线交流服务以及网上查询服务。目前，基金管理人已经开始提供网上交易服务。

### (五) 资讯服务

1、投资人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，可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：4007005588

传真：021-50499663、50499667

### 2、互联网站

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

电子信箱：[fsf@fsfund.com](mailto:fsf@fsfund.com)

## 二十三、其他应披露事项

(一) 本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；基金未进行收益分配；基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查与处罚。

(二) 本报告期内，本基金在指定媒体刊登的公告如下：2007年12月6日刊登了《招商银行开办华宝兴业基金管理有限公司的定期定额投资计划和转换业务的公告》、2007年12月13日刊登了《关于部分基金增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告》、2007年12月25日刊登了《多策略增长开放式证券投资基金更新的招募说明书（摘要）》、2007年12月27日刊登了《关于华宝兴业基金管理有限公司部分基金增加中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告》、2008年1月3日刊登了《关于对华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金实施基金份额拆分的公告》、2008

年1月9日刊登了《关于华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金份额拆分比例的公告》、2008年1月16日刊登了《民生银行开办华宝兴业基金管理有限公司旗下所有基金的转换业务的公告》、2008年1月17日刊登了《多策略增长开放式证券投资基金暂停申购和转入业务的公告》、2008年1月18日刊登了《多策略增长开放式证券投资基金2007年第四季度报告》、2008年2月28日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下基金的公告》、2008年3月20日刊登了《关于华宝兴业基金管理有限公司在中国工商银行开办基金定期定额投资计划业务的公告》、2008年3月21日刊登了《多策略增长股票型证券投资基金第三次分红预告》、2008年3月26日刊登了《华宝兴业多策略增长股票型证券投资基金第三次分红公告》、2008年4月11日刊登了《关于华宝兴业基金管理有限公司部分基金增加中银国际证券有限责任公司为代销机构的公告》、《关于华宝兴业基金管理有限公司增加恒泰证券有限责任公司为代销机构的公告》和《关于华宝兴业基金管理有限公司部分基金增加中信银行股份有限公司为代销机构的公告》、2008年5月15日刊登了《关于华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金暂停申购和转入业务的公告》。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和代销机构的办公场所和营业场所。投资人可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

备查文件包括：

- (一) 中国证监会批准华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金募集的文件
- (二) 《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》
- (三) 《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金托管协议》
- (四) 《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金业务规则》
- (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

其中，《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》和《华宝兴业多策略增长开放

式证券投资基金托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2008年6月25日