

天治创新先锋股票型  
证券投资基金  
更新的招募说明书

( 2014 年第 1 次更新 )

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 【重要提示】

本基金经中国证监会 2008 年 2 月 22 日证监许可【2008】297 号文核准募集。本基金的基金合同于 2008 年 5 月 8 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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核，除特别说明外，本次更新的招募说明书所载内容截止日为 2014 年 5 月 8 日，有关财务数据截止日为 2014 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

# 目录

一、绪言 .....	3
二、释义 .....	4
三、基金管理人 .....	9
四、基金托管人 .....	17
五、相关服务机构 .....	22
六、基金的募集 .....	43
七、基金合同的生效 .....	44
八、基金份额的申购与赎回 .....	45
九、基金的转换及定期定额投资计划 .....	53
十、基金的非交易过户与转托管 .....	54
十一、基金份额的冻结、解冻及质押 .....	55
十二、基金的投资 .....	56
十三、基金的业绩 .....	67
十四、基金的财产 .....	68
十五、基金财产的估值 .....	70
十六、基金的收益与分配 .....	77
十七、基金的费用和税收 .....	79
十八、基金的会计与审计 .....	81
十九、基金的信息披露 .....	82
二十、风险揭示 .....	86
二十一、基金合同的终止和基金财产的清算 .....	89
二十二、基金合同的内容摘要 .....	91
二十三、基金托管协议的内容摘要 .....	107
二十四、对基金份额持有人的服务 .....	121
二十五、其他应披露事项 .....	123
二十六、招募说明书的存放及查阅方式 .....	125
二十七、备查文件 .....	126

## 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》)及其他有关规定以及《天治创新先锋股票型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了天治创新先锋股票型证券投资基金的投资目标、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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：**指天治创新先锋股票型证券投资基金；
- 基金合同：**指《天治创新先锋股票型证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书或本招募说明书：**指《天治创新先锋股票型证券投资基金招募说明书》；
- 更新的招募说明书：**指根据相关法律、法规、规定对《天治创新先锋股票型证券投资基金招募说明书》进行的定期更新；
- 托管协议：**指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天治创新先锋股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
- 业务规则：**指《天治基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 发售公告：**指《天治创新先锋股票型证券投资基金基金份额发售公告》；
- 中国证监会：**指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：**指中国银行业监督管理委员会；
- 法律法规：**指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 《基金法》：**指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订；
- 《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25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8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》；
- 元：**指人民币元；
- 基金合同当事人：**指受本基金合同约束，根据本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、基金托管人和基金份额持有人；
- 基金管理人：**指天治基金管理有限公司；
- 基金托管人：**指交通银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：**指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资人；
- 注册登记业务：**指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务。具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记人：**指办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记人为天治基金管理有限公司或天治基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记业务的机构；
- 投资人：**指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：**指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
- 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和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；
- 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》及相关法律法规规定，经中国证监会批准可以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的机构投资者；
- 基金份额持有人大会：**指按照基金合同之规定召集、召开并由基金份额持有

人进行表决的会议；

**基金募集期：**指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；

**基金合同生效日：**指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

**存续期：**指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；

**工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

**认购：**指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

**申购：**指在本基金合同生效后的存续期间，投资人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；

**巨额赎回：**指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额10%的情形；

**基金转换：**指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为；

**转托管：**指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的行为；

**投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

- 代销机构：**指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；
- 销售机构：**指基金管理人及本基金代销机构；
- 基金销售网点：**指基金管理人的投资理财中心及基金代销机构的代销网点；
- 基金账户：**指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：**指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 开放日：**指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；
- T 日：**指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T+n日：**指T日后（不包括T日）第n个工作日；
- 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：**基金资产总值是指本基金购买各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金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；
- 基金份额净值：**指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的财产净值；
- 基金财产估值：**指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
- 指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互

联网网站；

**不可抗力：**

指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，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：天治基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：赵玉彪

成立时间：2003 年 5 月 27 日

电话：021—60371155

联系人：张丽红

注册资本：1.6 亿元人民币

股权结构：吉林省信托有限责任公司出资 9800 万元，占注册资本的 61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 6200 万元，占注册资本的 38.75%。

#### (二) 主要人员情况

##### (1) 基金管理人董事、监事、经理层成员

赵玉彪先生：董事长，博士，历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部交易部经理、吉林省信托有限责任公司上海洪山路证券营业部经理兼驻上海证券交易所上市代表、上海金路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司董事长、总经理，现任天治基金管理有限公司董事长，天治资产管理有限公司董事长、天治资产管理有限公司投资决策委员会成员。

高福波先生：董事，研究生学历，高级经济师，历任吉林省白山市人民银行任办公室主任、副行级助理稽察、吉林省白山市农村信用联社任理事长、党委书记、吉林省农村信用联社任资金信贷处负责人、副主任，现任吉林省信托有限责任公司党委书记、董事长。

柏广新先生：董事，博士，高级经济师，历任吉林省黄泥河林业局副局长、党委书记，中共吉林省延边朝鲜族自治州委员会宣传部常务副部长，延边州人民政府副秘书长，延边州林业管理局局长兼吉林延边林业集团董事长，现任吉林森工集团有限责任公司董事长、党委书记，全国人大代表。

常永涛先生：董事，总经理，学士，历任四川省信托投资公司上海证券总部

副总经理、大成基金管理公司交易员、基金经理助理、基金经理、申万巴黎基金管理公司基金经理、投资部总经理，2009年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司总经理。

李洁思女士：独立董事，自1991年7月至2007年12月在吉林省延边朝鲜族自治州政府工作。在工作期间曾任延边州政府副秘书长、副州长、常务副州长，分管过政法、经济、金融等工作，现已退休。

刘星星先生：独立董事，研究生、博士学位，高级咨询师，历任北京大学经济系讲师、The Monitor Company管理顾问、嘉实基金管理有限公司管理顾问，现任北京威兰德企业管理顾问有限公司董事长。

王明义先生：独立董事，研究生，曾任通化市矿务局工程处段长、吉林省白山市房产局技术员、建设银行白山市支行科长、中国银行白山市支行副行长、中国平安保险公司白山支公司总经理、现任吉林省保险行业协会中介部主任。

侯丹宇女士：监事会主席（职工监事），学士，历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部营业部经理、东北证券有限责任公司上海洪山路证券营业部总经理、天治基金管理有限公司督察长、副总经理，现任天治基金管理有限公司监事会主席（职工监事）。

邱荣生先生：监事，研究生学历，高级经济师，历任吉林省财政厅预算处科员、科长、副处长，香港振兴投资公司副总经理，吉林省财政厅副主任，吉林省信托有限责任公司工作办公室主任、财务部经理、总经理助理、副总经理，现任吉林省信托有限责任公司党委副书记、董事、总经理。

姚世家先生：监事，硕士，高级会计师，曾任吉林省天桥岭林业局太阳林场财务处会计、处长、吉林省天桥岭林业局总会计师、副局长、局长、吉林省敦化市林业局局长、吉林省敦化市市长，现任中国吉林森林工业集团有限责任公司副总经理。

白宇先生：职工监事，大学本科学历，助理经济师职称，2003年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司交易部总监。

许家涵先生：职工监事，经济学、商务英语双学士，2007年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司交易部副总监。

刘伟先生：督察长，学士，历任吉林省信托有限责任公司星火项目处项目负

责人、自营基金业务部副经理、上海全路达创业投资公司董事长，现任天治基金管理有限公司督察长。

闫译文女士：副总经理，吉林大学法学硕士，高级经济师，注册会计师，曾就职于吉林省信托有限责任公司，任下属公司财务主管、公司行政主管、业务部经理、党委委员、职工董事等职务，现任天治基金管理有限公司副总经理，天治资产管理有限公司风险控制委员会成员。

赵明女士：副总经理，经济学学士，历任辽宁东方证券公司客户经理、沈阳渤海投资咨询有限责任公司经理、沈阳天和信息技术有限公司市场部经理、天治基金管理有限公司市场营销部总监、宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司副总经理，现任天治基金管理有限公司副总经理。

时冰先生：副总经理，在职研究生，历任深圳蛇口经济发展总公司总助、海南新大洲摩托车股份有限公司副总经理、徐州市总工会科员、天相投资顾问有限公司营销策划负责人、天治基金管理有限公司北京分公司负责人、宏源证券股份有限公司营销董事总经理、天治基金管理有限公司总经理助理，现任天治基金管理有限公司副总经理。

## （2）本基金基金经理

陈勇先生：信号与信息处理专业硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验 5 年，历任（郑州）电子部第 27 研究所软件开发工程师、华为技术有限公司技术支持工程师、算法工程师、上海科旭通信电子有限公司算法工程师、中兴通讯股份有限公司策划经理、光大证券股份有限公司行业分析师、本公司研究发展部副总监、基金经理助理，现任本公司执行总监、权益投资部副总监，2014 年 1 月 29 日起任天治品质优选混合型证券投资基金的基金经理，2012 年 6 月 29 日起任本基金的基金经理。

本基金历任基金经理：2008 年 5 月 8 日至 2008 年 10 月 30 日，余明元先生任基金经理；2008 年 6 月 30 日至 2010 年 1 月 20 日，耿广棋先生任基金经理；2010 年 1 月 20 日至 2012 年 8 月 31 日龚炜先生任基金经理。

## （3）投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理兼投资总监常永涛先生，执行总监、权益投资部副总监兼天治创新先锋股票型证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金基金经理陈勇先生，执行总监、固定收益部总监兼天治稳健双盈债券型证券投资

资基金、天治稳定收益债券型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金基金经理秦娟女士，执行总监、研究发展部总监兼电子商务部总监吴战峰先生。

(4) 上述人员之间无亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

基金管理人应当履行下列职责：

(1) 依法募集基金，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) 编制基金季度、半年度和年度报告；

(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) 基金管理人的承诺

(1) 基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生；

(2) 基金管理人承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止以基金财产从事下列行为：

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) 不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；
- 9) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

### (3) 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、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。

### (五) 基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章。其中内控大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导，内控大纲明确了内控目标、内控原则、内控环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、基金会计制度、信息披露制度、档案管理制度、信息系统管理制度、行政管理制度、监察稽核制度和危机处理制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

#### (1) 风险管理和内部控制的原则

- 1) 健全性原则：内部控制应当覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。
- 2) 有效性原则：内部控制应当科学、合理、有效，公司全体职员必须竭力维护内部控制制度的有效执行，任何职员不得拥有超越制度约束的权力。

3) 独立性原则：公司应当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机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立性。监察稽核部保持高度的独立性和权威性，协助和配合督察长负责对公司各部门内部风险管理工作进行稽核和检查。

4) 相互制约原则：内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互牵制，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。

5) 防火墙原则：公司基金财产、固有财产和其他财产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位应当在物理上和制度上适当隔离。

6) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

7) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，公司将根据国家法律法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时对公司内部控制体系进行相应的修改和完善。

8) 定性和定量相结合原则：在以上原则的基础上，建立定量的风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

## (2) 风险管理和内部控制组织体系及职能

公司内部控制组织体系是一个分工明确的组织结构，具体而言包括如下组成部分：

1) 董事会合规与风险控制委员会：作为董事会下设的专门委员会，其主要职能是：检查公司经理层遵守有关法律法规和公司章程规定的情况；监督、控制公司在机构设置、管理制度、经营决策程序、内控体系等方面的合规合法性，发现问题及时向董事会汇报；研究拟订公司的风险管理战略和政策，报董事会批准；组织制订公司风险控制制度；检查公司风险控制制度的完善性；检查评估公司风险控制制度的执行情况；检查公司部门内部控制制度的制定、完善和执行；负责组织对公司存在的重大风险隐患或出现的重大风险事故进行内部调查，并将调查结果和处理意见报告董事会，由董事会决议作出处理。

2) 督察长：督察长负责公司的督察稽核工作，对董事会负责，对公司的各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

3) 内部控制委员会：内部控制委员会是公司内部协助经营管理层进行

风险控制与风险管理的非常设机构，负责公司内部控制层面的风险监控。

4) 投资决策委员会：投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，在内部控制组织体系中负责基金投资决策层面的风险管理。

5) 监察稽核部：监察稽核部全面负责公司的监察稽核工作，对公司内部控制制度和风险管理政策的执行情况进行合规性监督检查，向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见或建议。

6) 各业务部门：风险控制是每一个业务部门和员工重要的责任。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各个员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、本人的岗位职责进行自律。

### (3) 风险管理和内部控制基本制度

#### 1) 风险控制制度

内部风险控制制度由一系列的具体制度构成。公司根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线：即一线岗位自控与互控为基础的第一层监控防线；部门内各子部门、部门和部门之间的自控和互控为基础的第二层监控防线；内部监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈的第三层监控防线；以内部控制委员会为主体的第四层监控防线，实施对公司各类业务和风险的总体控制。

#### 2) 监察稽核制度

公司设立独立的监察稽核部门。监察稽核部门的职责是依据国家的有关法律法规和公司内部控制制度，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。

#### 3) 投资管理制度

本公司制定的基金投资管理制度和业务操作规程包括基本管理制度、部门管理制度以及业务手册三个层次。①本公司制定的基金投资基本管理制度用以规范基金投资管理方面的工作，包括投资管理的基本原则、决策程序、组织架构，以及投资管理过程中涉及的投资、研究、交易、投资表现评估、投资风险分析和风险控制等工作的基本规范、程序和职责等。②投资管理相关部门权益投资部、固定收益部、交易部和研究发展部等分别制定了部门管理制度，用以规范每个部门的岗位、职责、业务和人员等。③编制投资管理业务手册，包括《投资手册》、

《交易手册》、《研究手册》等，作为基本管理制度和部门管理制度的重要补充，用以保证投资管理相关工作规范、有序、优质、高效地进行。

#### 4) 会计控制制度

公司通过严格执行国家有关法律法规、会计政策和制度，做好公司各项经营管理活动的会计核算和财务管理工作；并做好公司所管理的基金财产的会计核算工作，以如实反映和记录基金财产运作的情况。

公司确保基金财产与公司固有财产完全分开，分别设立账户进行管理，独立核算，公司股东和债权人不得对基金财产主张权利，公司会计核算与基金会计核算在业务规范人员岗位和办公区域上进行严格区分。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金财产的完整和独立。

#### 5) 技术系统控制制度

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

#### (4) 基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立、实施、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实准确，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：裴学敏

电话：021-95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于 2005 年 6 月和 2007 年 5 月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国 2010 年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。交通银行连续五年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 243 位，较上年提升 83 位；列《银行家》杂志全球 1,000 家最大银行一级资本排名第 23 位，较上年提升 7 位。截至 2013 年 12 月 31 日，交通银行资产总额达到人民币 5.96 万亿元，实现净利润人民币 622.95 亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

#### (二) 主要人员情况

牛锡明先生，交通银行董事长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009 年 12 月起担任交通银行行长，2013 年 5 月起担任交通银行董事长。

钱文挥先生，交通银行副行长，上海财经大学工商管理硕士。2004 年 10 月起任交通银行副行长，2007 年 8 月起任交通银行执行董事。

刘树军先生，交通银行资产托管部总经理。管理学硕士，高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，农行总行托管部及养老金中心副总经理，交通银行内蒙古分行副行长。2011年10月起任交通银行资产托管部副总经理，2012年5月起任交通银行资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止2014年一季度末，交通银行共托管证券投资基金103只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面200ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数、富安达策略精选混合、金鹰中证500指数分级、工银瑞信纯债定期开放债券、富安达收益增强债券、易方达恒生中国企业ETF、易方达恒生中国企业ETF联接、光大保德信添盛双月债券、浦银安盛幸福回报债券、浙商聚盈信用债债券、德邦优化配置股票、汇添富理财28天债券、金鹰元泰精选信用债债券、诺安中小板等权重ETF、诺安中小板等权重ETF联接、中邮稳定收益债券、富安达现金通货币、东吴内需增长混合、建信优势动力股票(LOF)、浦银安盛新兴产业混合、农银高增长股票、建信央视财经50指数分级、工银安心增利场内货币、易方达保证金货币、东吴鼎利分级债券、德邦德信中高企债指数分级、

天治可转债、华安双债添利债券、工银信用纯债两年定开债券、农银行业领先股票、嘉实丰益策略定期开放债券、工银瑞信月薪债券、国联安中证医药 100 指数、上投摩根岁岁盈定期开放债券、方正富邦互利定期开放债券、建信周盈安心理财债券、博时灵活配置混合、鹏华丰融定期开放债券、农银汇理 14 天理财债券、鹏华消费领先灵活配置混合、浦银安盛消费升级灵活配置混合、广发成长优选灵活配置混合、国开泰富岁月臻金定期开放信用债券型、兴业定期开放债券、浦银安盛日日盈货币型证券投资基金。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等 12 类产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、全面性原则：通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

2、独立性原则：交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置账户，独立核算，分账管理。

3、制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

4、有效性原则：在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

5、效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部

控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

### 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

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：天治基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：赵玉彪

电话：021-60371155

传真：021-60374934

联系人：王珊珊、韩涵

客服电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

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

电子直销：天治基金网上交易平台“E 天网”

网址：<https://etrade.chinanature.com.cn>

#### 2、代销机构

##### （1）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客服电话：95559

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

##### （2）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

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客服电话：95588

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

(3) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(4) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

传真：010-85109219

联系人：熊奎

客服电话：95599

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

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

传真：010-68858117

联系人：陈春林

客服电话：95580

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

(6) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

联系人：刘玲

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(8) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

电话：010-65558888

传真：010-65550827

联系人：郭伟

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(9) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 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

电话：010-57092615

传真：010-57092611

联系人： 杨成茜

客服电话： 95568

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

（10）上海银行股份有限公司

住所： 上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址： 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人： 范一飞

电话： 021-68475888

传真： 021-68476111

联系人： 汤征程

客服电话： 95594

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

（11）北京银行股份有限公司

住所： 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址： 北京市西城区金融大街甲 17 号 8 层

法定代表人： 闫冰竹

电话： 010-66223584

传真： 010-66226045

联系人： 王曦

客服电话： 95526

网址： <http://www.bankofbeijing.com.cn>

（12）浙商银行股份有限公司

住所： 浙江杭州市庆春路 288 号

办公地址： 浙江杭州市庆春路 288 号

法定代表人： 张达洋

电话： 0571-87659546

传真： 87569188

联系人： 毛真海

客服电话： 95527

网址: <http://www.czbank.com/czbank/>

(13) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈有安

电话: 010-66568430

传真: 010-66568990

联系人: 田薇、宋明

客服电话: 4008888888

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

(14) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 万建华

联系人: 芮敏祺

客服电话: 4008888666

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

(15) 海通证券股份有限公司

住所: 上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

联系人: 李笑鸣

客服电话: 95553、4008888001

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

(16) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市安立路 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: 王常青

电话：010-85130544

联系人：权唐

客服电话：4008888108

网址：www.csc108.com

（17）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

电话：021-33388217

传真：021-33388224

联系人：李清怡

客服电话：021-962505

网址：www.sywg.com.cn

（18）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（19）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777

联系人：万鸣

客服电话：95597

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

(20) 兴业证券股份有限公司

住所: 福建省福州市湖东路 268 号

办公地址: 上海市浦东民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人: 兰荣

电话: 0591-38507679

联系人: 雷宇钦

客服电话: 95562、4008888123

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

(21) 东方证券股份有限公司

住所: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

办公地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

法定代表人: 潘鑫军

电话: 021-63325888

联系人: 吴宇

客服电话: 95503

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

(22) 金元证券股份有限公司

住所: 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人: 陆涛

电话: 0755-83025022

传真: 0755-83025625

联系人: 马贤清

客服电话: 4008888228

网址: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

(23) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：袁长清（代行）

联系人：刘晨

客服电话：10108998；4008888788

网址：www.ebscn.com

（24）长江证券股份有限公司

住所：武汉新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉新华路8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客服电话：95579、4008888999

网址：www.95579.com

（25）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096709

联系人：潘锴

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（26）万联证券有限责任公司

住所：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

电话：020-37865070

传真：020-22373718-1013

联系人：罗创斌

客服电话：4008888133

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

(27) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人: 李工

电话: 0551-65161666

传真: 0551-65161600

联系人: 甘霖

客服电话: 96518

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

(28) 华泰联合证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址: 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人: 马昭明

电话: 0755-82492000

传真: 0755-82492962

联系人: 庞晓芸

客服电话: 95513

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

(29) 第一创业证券有限责任公司

住所: 广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址: 广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人: 刘学民

电话: 0755-82485087

联系人: 崔国良

客服电话: 4008881888

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

(30) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(31) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

联系人：黄岚

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(32) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客服电话：4006661618 、95573

网址：www.i618.com.cn

(33) 国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人： 凤良志

联系电话： 0551—2272101

联系人： 李蔡

客服电话： 95578

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

（34）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人： 杨宇翔

传真： 0755-82450826

联系人： 郑舒丽

客服电话： 95511-8

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

（35）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人： 林俊波

电话： 021-68634518

传真： 021-68865680

联系人： 钟康莺

客服电话： 400-888-1551

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

（36）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人： 冯戎

电话： 010-88085858

传真： 010-88085195

联系人： 李巍

客服电话： 4008-000-562

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

(37) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：余江

客服电话：4008001001

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

(38) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表人：郭林

电话：021-32229888

联系人：陈敏

客服电话：021-63340678

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

(39) 东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333910

联系人：王一彦

客服电话：95531、4008888588

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

(40) 新时代证券有限责任公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

电话：010-83561149

传真：010-83561094

联系人：孙恺

客服电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn；

（41）国联证券股份有限公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

客服电话：4008885288，0510-82588168

网址：www.glsc.com.cn

（42）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

客服电话：4008008899

网址：www.cindasc.com

（43）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：林爽

客服电话：010-66045678

网址：<http://www.txsec.com>、<http://jijin.txsec.com>

(44) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客服电话：96326

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

(45) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客服电话：95558

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(46) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 21 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客服电话：95548

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

(47) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

电话：0571-85783737

传真：0571-85106383

联系人：李珊

客服电话：95548

网址：<http://www.bigsun.com.cn>

(48) 国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客服电话：95563

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

(49) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890619

联系人：曹占强

客服电话：0931-8888088

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

(50) 太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321818

传真：010-88321763

联系人：陈征

客服电话：0871-8898130 或致电各地营业网点

网址：www.tpyzq.com

（51）中天证券有限责任公司

住所：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 号甲

办公地址：沈阳市和平区南五马路 121 号 万丽城晶座 4 楼 中天证券

法定代表人：马功勋

电话：024-23280842

传真：024-86268016

联系人：袁劲松

客服电话：400-6180-315

网址：www.stockren.com

（52）西部证券股份有限公司

住所：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87406649

传真：029-87406710

联系人：刘莹

客服电话：95582

网址：www.westsecu.com

（53）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

电话：021-64316642

传真：021-54653529

联系人：陈敏

客服电话：4001099918（全国） 021-32109999；

网址：<http://www.cfsc.com.cn/>

(54) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服电话：4007009665

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

(55) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

电话：021-54509988

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客服电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(56) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

联系人：敖玲

客服电话：400-089-1289

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

(57) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：方成

客服电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（58）深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 、 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（59）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：021-20835789

传真：021-20835885

联系人：周轶

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com/>

（60）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：021-60897869

传真：0571-26698533

联系人：张裕

客服电话：4000 766 123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（61）北京万银财富投资有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内

法定代表人：李招弟

电话：010-59393923

传真：010-59393074

联系人：毛怀营

客服电话：400-808-0069

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（62）北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

客服电话：400-678-5095

网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

（63）北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020355

联系人：宋丽冉

客服电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

## （二）注册登记人

名称：天治基金管理有限公司

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：赵玉彪

电话：021-60371155

传真：021-60374974

联系人：周义

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

经办律师：廖海、田卫红

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：廖海

## （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

法定代表人：葛明

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

签章会计师：徐艳、蒋燕华

电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：蒋燕华

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集,并于 2008 年 2 月 22 日经中国证监会证监许可【2008】297 号文核准募集。

### （二）基金存续期间

不定期

### （三）基金类型

股票型证券投资基金

### （四）募集信息

1、本基金经中国证监会 2008 年 2 月 22 日证监许可[2008]297 号文批准,自 2008 年 3 月 18 日起至 2008 年 4 月 30 日向全社会公开募集。募集期募集的基金份额及利息转份额共计 248,496,003.92 份,募集户数为 3,919 户。

2、募集对象:本基金份额的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

3、募集场所:本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售,详情见基金份额发售公告。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效时间

本基金的基金合同于 2008 年 5 月 8 日生效。

### （二）基金存续期内基金份额持有人数量和资产规模限制

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

中国证监会另有规定的，按其规定办理。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。

条件成熟时，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### （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、赎回等业务的上海，深圳证券交易所交易日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券市场或其他特殊情况，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，最迟于调整生效日 2 日前在中国证监会指定媒体公告。

#### （2）申购的开始时间

本基金自 2008 年 8 月 6 日起开始办理申购，具体办理时间在本基金开放申购公告中规定。

#### （3）赎回的开始时间

本基金自 2008 年 8 月 6 日起开始办理赎回，具体办理时间在本基金开放赎回公告中规定。

（4）基金管理人开始办理申购、赎回业务时应当按照基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

（5）基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

### （三）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净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”的原则，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基金份额，基金管理人按照“先进先出”的原则处理，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回；

（4）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销，在基金管理人规定的时间之后不得撤销；

（5）基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施日 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### （1）申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### （2）申购与赎回申请的确认

本基金注册登记人应以交易时间结束前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 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

#### （3）申购与赎回申请的款项支付

申购时，采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内

支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照本基金合同有关条款处理。

### （五）申购和赎回的数额和价格

#### （1）申购金额、赎回份额及余额的处理方式

1) 每个基金账户首次申购的最低金额为 1,000 元人民币(含申购费)；投资者追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各代销机构网点公告，投资者通过直销中心追加申购的最低金额为 1,000 元人民币（含申购费）。

2) 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金份额；每个交易账户的最低基金份额余额不得低于 100 份，基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 100 份的，需一次全部赎回。如因分红再投资、非交易过户等原因导致的账户余额少于 100 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见定期更新的招募说明书。

基金管理人可根据市场情况，调整以上申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，并于调整实施 2 日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （2）申购赎回费率

##### 1) 申购费率

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。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，不列入基金财产。

具体费率如下：

申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 25 万元	1.5%
25 万元 ≤ M < 100 万元	1.0%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	每笔收取 1200 元

##### 2) 赎回费率

本基金的赎回费率随持有年限的增加逐步递减：

持有期限 (N)	赎回费率
N < 1 年	0.5%

1年 $\leq$ N $<$ 2年	0.3%
N $\geq$ 2年	0

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额 25% 的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率。

### （3）申购份额的计算

本基金基金申购份额的计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

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

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

以上计算结果（包括申购份额）以四舍五入的方式保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例，假定某投资人申购本基金 10,000 元，T 日本基金的基金份额净值为 1.2 元。则该笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.20 = 8,210.18 \text{ 份}$$

即投资人投资 10,000 元申购本基金，可得到 8,210.18 份基金份额。

### （4）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。计算公式为：

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

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

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

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损

失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例，假定某投资人持有该基金满 1 年但不满 2 年，在 T 日赎回其持有的基金份额 10,000 份，T 日的基金份额净值为 1.2 元，则投资人获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.2 = 12,000 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,000 \times 0.3\% = 36 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 12,000 - 36 = 11,964 \text{ 元}$$

#### (5) 基金份额净值的计算公式

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。计算公式为：

$$\text{T 日基金份额净值} = \text{T 日基金资产净值} / \text{T 日基金总份额余额}$$

### (六) 申购与赎回的注册登记

(1) 经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

(2) 投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

(3) 投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

(4) 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 2 日予以公告。

### (七) 巨额赎回的认定及处理方式

#### (1) 巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

#### (2) 巨额赎回的处理方式

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

1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占该基金赎回及转出申请总量的比例，确定当日受理的赎回或转出份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的该基金的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 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。

(3) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当在 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。

#### (八) 拒绝或暂停接受申购、暂停赎回的情形及处理

(1) 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；
- 2) 证券交易所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 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，或其他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的情

形；

5) 基金管理人认为有正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4) 项情形时，基金管理人应向中国证监会备案并公告。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(2) 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

2) 证券交易所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3) 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4) 项情形时，基金管理人应向中国证监会备案及公告。

已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

(3) 暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值；

2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 2 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放

申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值；

3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

## 九、基金的转换及定期定额投资计划

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为。

基金管理人已为投资人开办本基金与基金管理人旗下在同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的基金转换业务。基金转换可以收取一定的转换费，具体计算公式如下：

$$\text{转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + M$$

$$\text{转出基金赎回费} = B \times C \times D$$

$$\text{转换补差费} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / \text{转换申请当日转入基金的基金份额净值}$$

其中：B 为转出基金份额

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值

D 为转出基金赎回费率

G 为基金转换申购补差费率

M 为货币市场基金全部转出时账户当前累计的未付收益或部分转出且账户当前累计未付收益为负时按转换比例结转的当前累计未付收益（仅限转出基金为货币市场基金）

定期定额投资计划指基金投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。基金管理人已推出旗下部分基金定期定额投资计划，具体情况详见基金管理人发布的相关公告。

## 十、基金的非交易过户与转托管

(一) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的投资者。其中：

(1) “继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

(2) “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

(3) “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理，并按基金注册登记人规定的标准收费。

(三) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点)时，投资人可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十一、基金份额的冻结、解冻及质押

（一）基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

（二）在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金注册登记人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，公布并实施相应的业务规则。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

本基金专注于投资创新先锋型公司，追求持续稳健的长期回报。

### （二）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，其中，股票资产的 80%以上投资于本基金界定的创新先锋型公司；债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%—40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。

### （三）投资理念

无论是企业经营还是投资管理，唯有着眼未来，不断开辟价值创新的领域，方能持续领先，通过持久的高增长为投资者创造稳健的高回报。

### （四）投资策略

本基金以股票品种为主要投资标的，优选通过差异化和低成本不断创造新价值、追求持续领先优势的创新先锋型公司，分享其价值创新带来的高成长收益。

投资策略包括以下几个层面：

#### （1）股票投资策略

通过对基于差异化战略的创新能力和基于低成本战略的管理能力的考察，筛选出现有的和潜在的价值创新型上市公司，在此基础上，从不同类型的价值创新型公司中，优选出财务品质优秀、成长性良好、价值低估的创新先锋型品种，构建本基金的股票投资组合。

##### 1) 价值创新型公司选择

### ①价值创新型公司界定

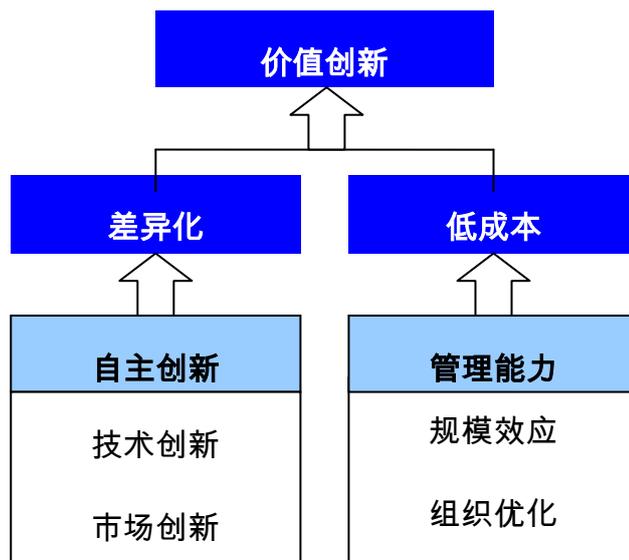
价值创新型公司对“价值”和“创新”同样重视，其不将目标放在打败竞争对手上，而是通过自主创新实施差异化（Differentiation）战略，创造有效的新需求，开辟新市场，同时凭借管理能力推进低成本（Low cost）战略，从而实现客户价值和公司价值的双重飞跃。

随着国家自主创新战略的大力推进，中国将产生众多具有自主创新能力的价值创新型企业群，这些企业群将是未来中国经济和社会发展中最具活力和成长动力的领域。

本基金通过定性和定量相结合的方法，对上市公司基于差异化战略的自主创新能力和基于低成本战略的管理能力进行考察，从符合定性特征且定量指标优秀的上市公司中，选择出现有的和潜在的价值创新型公司：

A. 差异化：价值创新型公司主要通过技术创新、市场创新、整合创新等路径实施差异化战略，提供新的产品和服务，追求在某一个或某几个细分市场的持续领先。本基金主要通过以下指标考察上市公司基于差异化战略的创新能力：新产品开发频率、新产品产值率、新产品市场占有率、研发费用占销售收入比。

B. 低成本：价值创新型公司主要通过规模效应、组织优化、财务管理等手段实施低成本战略，进而制定合理价格，形成有效的进入壁垒，更为持久地获取领先优势的成果。本基金主要通过以下指标考察上市公司基于低成本战略的管理能力：新产品成本下降率、主营业务成本下降率、期间费用下降率。



## ②价值创新型公司分类

根据差异化战略的实施路径，本基金将价值创新型公司划分为以下三种类型：

A. 技术创新类价值创新型公司：主导产品和技术属于国家科技政策扶持的国民经济和社会发展重点领域的优先技术主题、重大技术专项、前沿技术领域或者国家相关产业政策扶持的领域，以上领域不仅包括高新技术产业，而且广泛涵盖农业、采掘业、制造业、交通运输业等众多传统行业；具有较强的自主创新能力或潜力，拥有具有自主知识产权的技术或品牌，积极主导或参与国际、国家或行业技术标准的制定。

B. 市场创新类价值创新型公司：主要通过产品创新域和客户创新域，在现有的成熟产品上开发新的效用，或者将现有技术融入成熟产品或服务，或者运用新的营销模式，改变产品的功能、质量、外观、价格、服务等属性或者改变目标客户，创造出新的需求。

C. 整合创新类价值创新型公司：技术创新或者市场创新类公司通过细分市场的重组对现有需求进行整合，或者非价值创新型公司通过并购技术创新或市场创新类公司进入新的市场；整合创新利于降低研发费用的固定成本，增强信息和资源的获取能力，提升创新效率，实现规模经济效益。

### 2) 创新先锋型公司优选

①以毛利率、主营业务利润增长率、每股经营性现金净流量等更为适

用于价值创新型公司的指标为主，辅以净资产收益率等财务指标，对价值创新型公司的财务品质进行综合评价。

②对不同类型的价值创新型公司运用不同的指标考察其基于价值创新能力的成长性：

A. 对于偏重于技术创新的价值创新型公司，主要通过成长流量(Growth Flow) 增长率考察其成长性。成长流量为每股收益与每股研发费用之和，反映了价值创新型公司历史盈利能力和潜在创新能力。成长性考察还将分别对每股收益与每股研发费用的增长率进行分析。

B. 对于偏重于市场创新的价值创新型公司，主要通过每股主营业务收入增长率考察其成长性。

C. 对于偏重于整合创新的价值创新型公司，主要通过整合前后每股收益的变化考察其成长性。

③主要运用 PEG 指标，再辅以 PGF、PS、PE 等指标，从财务品质优秀、成长性良好的价值创新型公司中选择价值低估的品种，构建创新先锋型公司股票组合。

## (2) 债券投资策略

本基金将小部分基金资产投资于国债、金融债、企业债、可转债、央行票据等债券品种。债券投资在综合考虑宏观经济因素和债券品种特征因素的基础上，运用利率预期、久期管理、收益率利差分析、套利交易等策略进行债券久期配置、类属配置，获取债券市场的长期稳定收益。

## (3) 权证投资策略

本基金将在有效进行风险管理的前提下，通过对权证标的证券的基本面研究，并结合期权定价模型估计权证价值，谨慎进行投资。

## (4) 其他衍生工具的投资策略

本基金将对国内各种金融衍生产品的动向进行密切关注，在衍生产品推出市场之后，届时将依照相应的法律法规，制定适合本基金投资目标的投资策略，并结合对衍生产品标的工具的研究，充分评估衍生产品的风险和收益特征，谨慎进行投资。

## (五) 投资决策流程

为保证基金投资原则、投资策略的执行和投资目标的实现，本公司采用较为科学合理的分层决策体制：即实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会为公司最高投资决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题；基金经理在其权限范围负责所管理基金的日常投资组合管理工作，并具体落实投资决策委员会关于该基金的投资管理决议。

在上述分层决策体制的前提下，本基金采用团队式投资管理模式，权益投资部、研究发展部、产品创新及量化投资部的相关人员共同组成基金管理小组。本基金具体的投资决策流程分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与调整、风险控制五个环节。

### （1）投资研究

研究发展部策略分析师、行业与公司研究员、债券研究员以及产品创新及量化投资定量分析师负责研究分析工作，并完成基金投资分析报告（包括宏观经济、市场、行业、投资品种和投资策略等分析），为投资决策委员会和基金经理提供投资决策依据。

### （2）投资决策

#### 1) 确定投资原则和投资限制

投资决策委员会根据国家有关法律法规的规定、基金合同及公司的有关管理制度，确定基金投资的基本政策和原则性规定，包括基本目标、基本原则和投资限制等。

#### 2) 制定投资计划和项目方案

基金经理依据基金投资分析报告和外部研究力量的研究成果，依据本基金产品的投资原则、投资限制等要求，结合自身对证券市场的研究、分析和判断，按月制定投资策略与投资组合建议表，并提交投资决策委员会审定每月基金的资产配置比例和股票、债券的投资重点。如遇重大情况，投资决策委员会也可以召开临时会议做出决策。

基金经理依据上述投资决策委员会审定的资产配置比例和投资重点，根据每周的投资研究联席会议，决定该周具体的投资策略，再辅以每日晨会对当日重大讯息进行讨论，制定具体的投资计划和项目方案。

#### 3) 投资方案的论证和审批

一般投资可由基金经理自主决定，制成投资决定书后，向投资总监备案。重要投资必须根据投资决策委员会制定的投资审批程序和相关规定向投资总监和投资决策委员会报告，取得相应批准。投资决策委员会在审批投资计划和项目方案之前必须召开投资决策听证会，由基金经理和相关研究人员阐述投资理由和投资依据。

#### 4) 投资授权和方案实施

重要投资计划和项目方案得到投资决策委员会批准后由基金经理制成投资决定书，经投资总监复核后，由基金经理在授权的范围内组织实施。

#### (3) 投资执行

交易部交易员依据基金经理的投资决定书，执行基金经理的交易指令，对交易情况及时反馈，对投资指令进行监督，并作成基金投资执行表，若执行时发生差异，则需填写差异原因，并呈报基金经理及投资总监。

#### (4) 投资跟踪与调整

基金经理根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、研究员与定量分析师的投资跟踪分析报告和建议等，进一步分析判断，并据此在权限范围内及时调整投资组合。一般情况下，基金经理按月向投资决策委员会、投资总监就投资现况进行总结，并提出投资总结报告。如果遇有重大变化需要修改投资计划和项目方案，必须报投资决策委员会批准后方可实施。

#### (5) 风险控制

产品创新及量化投资部定期和不定期对本基金进行数量化风险分析和绩效评估，并提供相关报告给基金经理、投资决策委员会，使其能够了解投资组合（或拟投资的组合）的风险水平，为基金经理和投资决策委员会提供决策支持。

投资决策委员会在确保基金持有人利益的前提下有权根据市场变化和实际需要对上述投资管理流程作出调整。

### (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%。

中信标普 300 指数为本基金股票投资的业绩比较基准，中信标普国债指数为

本基金债券投资的业绩比较基准。中信标普 300 指数选择中国 A 股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，可以描述 A 股市场的总体趋势，是开放式基金广泛应用的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数涵盖深沪两市挂牌的国债，反映交易所国债市场整体走势，是开放式基金广泛应用的债券投资业绩比较基准。

如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出，本基金可以在经过适当的程序后变更业绩比较基准。

### （七）风险收益特征

本基金为具有较高收益、较高风险的股票型基金。

### （八）投资禁止行为与限制

#### （1）禁止用本基金财产从事以下行为

- 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) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

#### （2）基金投资组合比例限制

- 1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金

总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

5) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

6) 本基金投资的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过本基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过本基金资产净值的 20%；

8) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字[2006]141 号）及相关规定执行；

9) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

10) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

(3) 法律法规或监管部门修改或取消上述投资禁止行为或投资限制规定时，本基金在履行适当程序后不受上述投资禁止行为和投资组合比例限制。

### **(九) 投资组合比例调整**

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

### **(十) 基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法**

- (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) 按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资人利益；
- (4) 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### (十一) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2014 年 3 月 31 日。所列财务数据未经审计。

#### 1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	157,555,176.74	76.63
	其中：股票	157,555,176.74	76.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	42,269,412.05	20.56
6	其他各项资产	5,793,653.53	2.82
7	合计	205,618,242.32	100.00

#### 2、期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	90,277,608.35	44.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,071,000.00	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,526,459.00	15.95
J	金融业	7,297,100.00	3.58
K	房地产业	15,901,200.00	7.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,481,809.39	3.67
S	综合	-	-
	合计	157,555,176.74	77.25

### 3、基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	002085	万丰奥威	490,000	9,535,400.00	4.68
2	300219	鸿利光电	700,000	8,778,000.00	4.30
3	300212	易华录	150,000	7,050,000.00	3.46
4	600757	长江传媒	820,207	6,668,282.91	3.27
5	300315	掌趣科技	200,000	6,436,000.00	3.16
6	002358	森源电气	300,000	6,435,000.00	3.15
7	002146	荣盛发展	500,000	6,175,000.00	3.03
8	002701	奥瑞金	140,000	6,090,000.00	2.99
9	002008	大族激光	450,000	5,958,000.00	2.92
10	002148	北纬通信	126,700	5,885,215.00	2.89

### 4、期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金无债券投资。

## 5、基金投资前五名债券明细

本报告期末本基金无债券投资。

## 6、期末基金投资前五名权证明细

本报告期末本基金无权证投资。

## 7、期末基金投资前十名资产支持证券明细

本报告期末本基金无资产支持证券投资。

## 8、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

## (3) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	245,448.28
2	应收证券清算款	5,359,860.71
3	应收股利	-
4	应收利息	18,220.29
5	应收申购款	170,124.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,793,653.53

## (4) 期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002148	北纬通信	5,885,215.00	2.89	重大事项公告

### 十三、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及其与同期业绩比较基准收益率比较表：

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)
2008年5月8日(基 金合同生效日)—2008 年12月31日	-8.55%	1.13%	-33.95%	2.05%	25.40%	-0.92%
2009年1月1日— 2009年12月31日	34.99%	1.74%	66.78%	1.42%	-31.79%	0.32%
2010年1月1日— 2010年12月31日	23.90%	1.59%	-6.93%	1.09%	30.83%	0.50%
2011年1月1日— 2011年12月31日	-36.55%	1.44%	-16.64%	0.91%	-19.91%	0.53%
2012年1月1日— 2012年12月31日	10.52%	1.43%	6.06%	0.87%	4.46%	0.56%
2013年1月1日— 2013年12月31日	23.31%	1.82%	-3.53%	0.96%	26.84%	0.86%

## 十四、基金的财产

### （一）基金财产的构成

#### （1）基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1) 银行存款及其应计利息；
- 2) 结算备付金及其应计利息；
- 3) 根据有关规定缴存的保证金；
- 4) 应收证券交易清算款；
- 5) 应收申购基金款；
- 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) 其他资产等。

#### （2）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （二）基金财产的账户

本基金以基金托管人和“天治创新先锋股票型证券投资基金”联名的方式在基金托管人营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以“天治创新先锋股票型证券投资基金”的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和“天治创新先锋股票型证券投资基金”联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户、以“天治创新先锋股票型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### （三）基金财产的保管及处分

（1）本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

（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范围。

（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。

（5）基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十五、基金财产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

本基金合同生效后，每个工作日对基金财产进行估值。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### （四）估值方法

#### （1）股票的估值方法

1) 上市流通股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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### 2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

#### ④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第（1）条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股

票的以第（1）条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第（1）条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$ （FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天）。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （2）债券的估值办法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (3) 权证的估值方法

1) 上市流通权证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, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 以最近交易日的收盘价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的, 应对最近交易日的收盘价进行调整, 确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的权证, 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, 按成本估值。

3) 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 因持有股票而享有的配股权证, 以配股除权日起到配股确认日止, 若收盘价高于配股价, 则按收盘价和配股价的差额进行估值, 若收盘价低于配股价, 则估值为零。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (4) 资产支持证券的估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券, 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, 按成本估值。

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券, 根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (5) 股票指数期货合约的估值方法

1) 股票指数期货合约以结算价格进行估值。

2) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (6) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(7) 在任何情况下, 基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场各因素

的基础上,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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,发现方应及时通知对方,以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值,以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》,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,基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### **(五) 估值程序**

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以书面形式报给基金托管人,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,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。

### **(六) 暂停估值的情形**

- (1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- (2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时;
- (3) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### **(七) 基金份额净值的计算**

$T$ 日基金份额净值= $T$ 日基金资产净值/ $T$ 日基金总份额余额

基金份额净值的计算,精确到0.0001元,小数点第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

### **(八) 估值错误的处理**

(1) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内(含第四位)发生差错时,视为基金份额净值估值错误。

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财产估值的

准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；估值错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；估值错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

## （2）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代销销售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。

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不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力。

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。

## （3）差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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；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，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。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，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) 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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

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、行政法规、本基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管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) 由于基金管理人原因导致的证券超买、证券超卖，而给基金托管人及基金托管人托管的其它资产造成的损失，均由基金管理人承担。

8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### (4) 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，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

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, 需要修改基金注册登记人的交易数据的, 由基金注册登记人进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认;

5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时, 基金管理人应当公告, 并报中国证监会备案。

### **(九) 特殊情形的处理**

(1) 基金管理人按估值方法的第(7)项进行估值时, 所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

(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, 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, 由此造成的基金财产估值错误, 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。

## 十六、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

（1）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、银行存款利息以及其他收入。

（2）因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（3）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）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（4）基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

（5）如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

（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多 6 次；

（7）每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的 50%。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

（8）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（9）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与公告

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，基金管理人应在 2 日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

#### （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；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

（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，或者现金红利低于基金管理人规定的数额的，注册登记人自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日经除权后的基金份额净值为计算基准转为基金份额。

## 十七、基金的费用和税收

### (一) 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### (二) 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

本基金的管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第(一)款第(3)至第(8)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### **(三) 不列入基金费用的项目**

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### **(四) 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协商酌情调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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

### **(五) 其他费用**

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### **(六) 税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

（1）基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日，如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度。

（2）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

（3）会计制度按国家有关的会计制度执行。

（4）本基金独立建账、独立核算。

（5）本基金会计责任人为基金管理人。

（6）基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金年度审计

（1）基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。

（2）会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

（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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后在 2 日内公告。

## 十九、基金的信息披露

### （一）披露原则

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。

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的报刊和网站披露，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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- （1）虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- （2）对证券投资业绩进行预测；
- （3）违规承诺收益或者承担损失；
- （4）诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- （5）登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- （6）中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （二）基金募集信息披露

（1）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，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上；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各自公司网站上。

（2）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媒体上。

（3）基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

（4）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。

### （三）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人复核。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。

（1）基金年度报告：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。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

（2）基金半年度报告：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。

（3）基金季度报告：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媒体上。

基金合同生效不足 2 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。

### （四）基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

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在指定媒体上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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

### （五）临时报告与公告

基金发生重大事件，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。

前款所称重大事件，是指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下列事件：

- (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百分之五十；
- (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百分之三十；
- (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百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金代销机构；
- (20) 更换基金注册登记人；
- (21) 基金开始办理申购、赎回；

- (22) 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 基金暂停接受申购、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。

#### **(六) 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。

#### **(七) 中国证监会规定的其他信息**

#### **(八) 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，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。

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，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。

## 二十、风险揭示

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，使基金运作客观上面临一定的市场风险。主要包括：

#### （1）政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，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

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### （3）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能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的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### （5）通货膨胀风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，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。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

### （四）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资人的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

### （五）技术风险

在开放式基金的后台运作中，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甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

### （六）特定风险

本基金主要通过对基于差异化战略的创新能力和基于低成本战略的管理能力的考察，筛选出现有的和潜在的价值创新型上市公司，在此基础上，从不同类型的价值创新型公司中，优选出财务品质优秀、成长性良好、价值低估的创新先锋型品种，构建本基金的股票投资组合。其中，对于上市公司价值创新能力的考察与成长性评估是本基金股票组合构建的关键所在，而上市公司价值创新能力是动态的、相对的，处于不断变化的动态过程，而且价值创新类公司的成长性还受到宏观经济、产业政策等众多因素的影响而具有一定的不确定性，因此，本基金

投资存在股票选择的特定风险。本基金将发挥专业研究优势，紧密跟踪不同行业和领域的创新动向，把握上市公司基本面的变化趋势，以有效控制本基金的特定风险。

### （七）其他风险

（1）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

（2）因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

（3）其他意外导致的风险。

## 二十一、基金合同的终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金的基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新的基金管理人、基金托管人承接的；
- （3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二）基金财产的清算

（1）基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### （2）基金财产清算组

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### （3）清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；

- 9) 公布基金清算公告;
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分

配。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

#### (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### （1）基金管理人的权利与义务

基金管理人的权利：

- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；
- 5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- 6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用；
- 7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同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，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 9) 自行承担基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- 11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
- 12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

13) 按照法律法规, 代表基金对被投资企业行使股东权利, 代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利;

14) 在基金托管人职责终止时, 提名新的基金托管人;

15) 依据法律法规和基金合同的规定, 召集基金份额持有人大会;

16) 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;

17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;

18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

#### 基金管理人的义务:

1) 依法募集基金, 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) 办理基金备案手续;

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

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

5) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务;

6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;

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

8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益, 不得委托第三人运作基金财产;

9) 接受基金托管人依法进行的监督;

10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定, 按照有关规定计算并公告基金份额净值, 确

定基金份额申购、赎回的价格；

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

13) 按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14) 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；

15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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

17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

19) 编制季度、半年度和年度基金报告；

20) 确保需要向基金份额持有人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约定的时间和方式，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；

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

22) 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；

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

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

25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

26) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损基金份额持有人的利益及资源分配；

27) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (2) 基金托管人的权利与义务

### 基金托管人的权利：

1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同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，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 基金托管人的义务：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

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

3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
- 7) 按照基金合同的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;
- 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以保密, 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、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格;
- 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人未执行基金合同规定的行为, 还应说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料, 保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上;
- 13) 根据有关法律法规, 建立并保存基金份额持有人名册;
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- 15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- 17) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 18) 参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 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和银行监管机构, 并通知基金管理人;
- 20) 基金管理人因违反基金合同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;
- 21) 因违反基金合同导致基金财产的损失, 应承担赔偿责任, 其责任

不因其退任而免除；

22) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

23) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (3) 基金份额持有人的权利与义务

基金份额持有人的权利：

1) 分享基金财产收益；

2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7) 监督基金管理人的投资运作；

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

9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

基金份额持有人的义务：

1) 遵守基金合同；

2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

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

7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或基金份额持有

人合法的授权代表共同组成。

(1) 召开事由

有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 更换基金管理人；
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6) 本基金与其它基金的合并；
- 7) 变更基金类别；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- 11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额

持有人大会的事项。

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；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动而应当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) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

(2) 召集人和召集方式

1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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（含 10%）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（含 10%）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（含 10%）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。

5) 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。

6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### (3) 通知

1) 召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- ① 会议召开的时间、地点和方式；
- ② 会议拟审议的主要事项；
- ③ 会议形式；
- ④ 议事程序；
- ⑤ 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- ⑥ 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代

理有效期限等)、送达时间和地点;

- ⑦ 表决方式;
- ⑧ 会务常设联系人姓名、电话;
- ⑨ 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- ⑩ 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### (4) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 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本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,但决定更换基金管理人或基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2) 召开基金份额持有人大会的条件

在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,有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 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。

在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行:

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

② 召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见;

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应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%);

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表,同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间,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。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表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弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (5) 议事内容与程序

##### 1) 议事内容及提案权

① 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

② 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上(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 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

③ 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进行解释和说明。

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做出决定。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做出决定, 并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

④ 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上(含 10%)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、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 6 个月。

⑤ 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案, 应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 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, 经讨论后在公证机关监督下进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上(含 50%)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、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## ② 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 天公布提案,在所通知的表决截止日期第 2 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。

3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (6) 表决

1) 基金份额持有人所持每一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

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

### ② 特别决议

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

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

4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## (7) 计票

### 1) 现场开会

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

份额持有人担任监票人。

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

③ 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如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 基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

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

## (8) 生效与公告

1) 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。

2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3) 基金份额持有人大会决议应自核准或备案后 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体公告。

## (三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (1) 基金合同的变更

以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- ① 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- ② 更换基金托管人；
- ③ 更换基金管理人；

④ 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；

⑤ 变更基金类别；

⑥ 变更基金投资目标、范围或策略；

⑦ 变更基金份额持有人大会程序；

⑧ 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它事项。

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

除上述第①项-第⑧项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

## (2) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

1) 基金份额持有人大会决定终止；

2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

## (3) 基金财产的清算

1) 基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2) 基金财产清算组

① 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

② 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

### 3) 清算程序

- ① 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ② 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③ 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④ 对基金财产进行评估和变现；
- ⑤ 基金清算组作出清算报告；
- ⑥ 会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑦ 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧ 将基金清算结果报告中国证监会；
- ⑨ 公布基金清算公告；
- ⑩ 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

### 4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

### 5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- ① 支付基金财产清算费用；
- ② 缴纳基金所欠税款；
- ③ 清偿基金债务；
- ④ 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分

配。

### 6) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

7) 基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存十五年以上。

## (4) 争议的处理

- 1) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商或调解方式解决,则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

3) 除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(5) 基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

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

2) 基金合同正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

3) 基金合同可印制成册,存放在基金管理人和基金托管人住所,供投资人查阅,基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### (1) 基金管理人

名称：天治基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：赵玉彪

成立时间：2003 年 5 月 27 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]73 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

注册资本：1.6 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### (2) 基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：蒋超良

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987]40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：489.94 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金的投资对象为上市交易的股票、债券和国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种，主要包括：

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，其中，股票资产的 80%以上投资于本基金界定的创新先锋型公司；债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%—40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。

基金管理人应在基金运作前，将界定为创新先锋型公司的股票池名单提供给基金托管人，基金托管人以此作为监督依据。如股票池变更，基金管理人应事先通知基金托管人。基金托管人在收到股票池 2 个工作日内电话或回函确认。

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- 1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 5) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- 6) 本基金投资的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；
- 7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过本基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过本基金资产净值的 20%；
- 8) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字[2006]141 号）及相关规定执行；
- 9) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；
- 10) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金在履行适当程序后相应修改其投资组合限制规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人

应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

基金托管人自基金合同生效之后依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出有关法律法规的规定及基金合同的约定的基金投融资比例限制的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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在 10 个工作日内纠正。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

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

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后 2 个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人以上投资禁止行为的，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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在 10

个工作日内纠正。

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，基金托管人于收到名单后 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

(5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时,应严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规,以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

(6) 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资其他方面进行监督。

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

(8) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,在规定时间内答复并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正,并通知基金管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,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 10 个工作日内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证

监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

### （三）基金管理人

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金

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在 10 个工作日内纠正。

### （四）基金财产的保管

#### （1）基金财产保管的原则

- 1) 基金托管人应安全保管基金财产。
- 2) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 3) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

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

基金托管人应安全、完整地保管基金资产; 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。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产, 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。基金托管人对此不承担任何责任。

#### (2) 基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期满之日起 10 日内, 募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后, 由基金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, 出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上 (含 2 名) 中国注册会计师签字有效。验资完成, 基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中, 基金募集的证券存放在基金托管人为基金开立的证券账户和债券托管账户下, 基金托管人在收到资金和证券当日出具相关证明文件。

#### (3) 基金的银行存款账户的开立和管理

1) 基金托管人应负责天治创新先锋股票型证券投资基金银行存款账户的开立和管理。

2) 基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在其营业机构开立基金的银行存款账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动, 包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益, 均需通过本基金的银行存款账户进行。

3) 本基金银行存款账户的开立和使用, 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基金的名义开立其他任何银行存款账户; 亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

4) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的

有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

5) 基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户、及时核查基金银行存款账户余额。

#### (4) 基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。

基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### (5) 债券托管账户的开立和管理

1) 募集资金验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。

2) 基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### (6) 基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，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。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

### (7) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应当尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## (五) 基金资产净值计算和会计核算

### (1) 基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后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盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人就基金份额净值予以公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

本基金应按照相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法进行估值，如该方法不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素，如银行间债券市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## （2）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

## （3）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

## （4）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会公布的《证券投资基金信息披露管理办法》要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在本基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理

方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### **（六）基金份额持有人名册的保管**

基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金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、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### **（七）争议解决方式**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性

的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## （八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （1）基金托管协议的变更

本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的托管协议报中国证监会核准后生效。

### （2）基金托管协议的终止

- 1) 《基金合同》终止；
- 2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- 3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；
- 4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### （3）基金财产的清算

#### 1) 基金财产清算组

自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

① 基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

② 基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2) 基金财产清算程序

- ① 《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ② 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③ 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④ 对基金财产进行评估和变现；
- ⑤ 基金清算组作出清算报告；
- ⑥ 会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑦ 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧ 将基金清算报告中国证监会；
- ⑨ 公布基金清算公告；
- ⑩ 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3) 清算费用

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

### 4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- ① 支付基金财产清算费用；
- ② 缴纳基金所欠税款；
- ③ 清偿基金债务；
- ④ 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分

配。

### 5) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

### 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。

## 二十四、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。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 持有人注册与过户登记服务

基金管理人设立注册登记中心,配备安全、完善的电脑系统及通讯系统,准确、及时地为投资者办理基金帐户的开立、变更、注销等业务;为投资者登记存管认购、申购、赎回等业务所发生的基金份额;为投资者提供基金账户和基金交易的资料查询。

### (二) 资料寄送服务

#### (1) 账户确认书

根据客户的需要,为客户寄送开放式基金账户确认书。

#### (2) 对账单

基金投资人对账单包括季度对账单和年度对账单。

季度对账单于每季结束后的 10 个工作日内向当季有交易的基金份额持有人寄送,年度对账单在每年度结束后 15 个工作日内对所有基金份额持有人寄送。

对账单的寄送方式分为邮寄和电子邮件两种方式。如投资人需要重置寄送方式或寄送频率,请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

#### (3) 其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### (三) 网络在线服务与网上交易服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱,投资者可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资者可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站为投资者提供基金账户开户、网上交易、帐户查询、电子对帐单申请、对账单寄送方式或频率设置、修改密码等多种服务。

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

电子信箱：marketing@chinanature.com.cn

#### **（四）信息定制服务**

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金投资者提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

#### **（五）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务**

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 8：30-17：00 为投资者提供服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

传真：021-60374934

#### **（六）投诉受理**

投资者可以拨打天治基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 2 个工作日之内对投资者的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

## 二十五、其他应披露事项

自 2013 年 11 月 9 日至 2014 年 5 月 8 日期间，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

1、2013 年 11 月 11 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金在中信银行开通基金转换业务的公告》。

2、2013 年 11 月 22 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于对旗下基金所持股票省广股份恢复采用收盘价估值方法的公告》。

3、2013 年 12 月 2 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金增加西部证券为代销机构的公告》。

4、2013 年 12 月 16 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金增加华鑫证券为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务的公告》、《天治基金管理有限公司旗下基金增加浙商银行为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》。

5、2013 年 12 月 23 日在指定媒体上刊登了《天治创新先锋股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2013 年第 2 次更新）》。

6、2013 年 12 月 24 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

7、2014 年 1 月 7 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于更换中国建设银行直销账户的公告》。

8、2014 年 1 月 21 日在指定媒体上刊登了《天治创新先锋股票型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告》。

9、2014 年 1 月 28 日在指定媒体刊登了《天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

10、2014 年 1 月 30 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持立思辰股票估值方法的公告》。

11、2014 年 3 月 7 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于对旗下基金所持股票立思辰恢复采用收盘价估值方法的公告》。

12、2014 年 3 月 10 日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金参加华鑫证券费率优惠活动的公告》。

13、2014年3月17日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分基金参加光大证券费率优惠活动的公告》。

14、2014年3月27日在指定媒体上刊登了《天治创新先锋股票型证券投资基金2013年年度报告摘要》。

15、2014年4月1日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》。

16、2014年4月19日在指定媒体上刊登了《天治创新先锋股票型证券投资基金2014年第1季度报告》。

17、2014年4月22日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分基金增加钱景财富为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》。

18、2014年4月25日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分基金增加展恒基金为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》、《天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

19、2014年4月26日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持鸿利光电股票估值方法的公告》。

20、2014年4月29日在指定媒体上刊登了《天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持北纬通信、光线传媒股票估值方法的公告》。

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。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的内容完全一致。

## 二十七、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- (一) 中国证监会核准天治创新先锋股票型证券投资基金募集的文件；
- (二) 《天治创新先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《天治创新先锋股票型证券投资基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 《天治基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

天治基金管理有限公司

2014年6月21日