

国泰成长优选股票型证券投资基金 更新招募说明书

(2013年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

截止日：二〇一三年九月二十日

重要提示

本基金经中国证监会证监许可【2011】2129号文核准募集。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人认购（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和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险及本基金的特有风险等。本基金为股票型基金，股票型基金的风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的品种。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2013年9月20日，投资组合报告为2013年2季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日。

目 录

| | |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 | 3 |
| 二、释义 | 3 |
| 三、基金管理人 | 6 |
| 四、基金托管人 | 18 |
| 五、相关服务机构 | 25 |
| 六、基金的募集 | 38 |
| 七、基金合同的生效 | 39 |
| 八、基金份额的申购与赎回 | 39 |
| 九、基金的投资 | 47 |
| 十、基金的业绩 | 58 |
| 十一、基金的财产 | 58 |
| 十二、基金资产的估值 | 59 |
| 十三、基金的收益与分配 | 64 |
| 十四、基金的费用与税收 | 65 |
| 十五、基金的会计和审计 | 67 |
| 十六、基金的信息披露 | 67 |
| 十七、风险揭示 | 72 |
| 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | 73 |
| 十九、基金合同摘要 | 76 |
| 二十、托管协议的内容摘要 | 89 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务 | 100 |
| 二十二、其他应披露事项 | 102 |
| 二十三、招募说明书存放及其查阅方式 | 104 |
| 二十四、备查文件 | 104 |

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》”)和其他有关法律法规的规定，以及《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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。国泰成长优选股票型证券投资基金(以下简称“基金”或“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：

- 1、基金或本基金：指国泰成长优选股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指国泰基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰成长优选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
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《国泰成长优选股票型证券投资基金招募说明书》及

其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《国泰成长优选股票型证券投资基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《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日起实施并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《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》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《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》及颁布机关对其不时做出的修订

13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有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

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、投资人：指个人投资者和机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

19、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

20、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

21、销售机构：指直销机构和代销机构

22、直销机构：指国泰基金管理有限公司

23、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务

资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、基金销售网点：指直销机构的直销柜台及代销机构的代销网点

25、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等

26、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

27、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、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工作日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、日：指公历日

37、月：指公历月

38、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《国泰基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要

求将基金份额兑换为现金的行为

43、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为

45、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购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

46、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%的情形

47、元：指人民币元

48、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

49、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、基金资产评估：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

53、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网站及其他媒体

54、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

55、不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法避免且无法克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何 眯

联系电话：021-38569000, 4008888688

股本结构：

| 股东名称 | 股权比例 |
|--------------|------|
| 中国建银投资有限责任公司 | 60% |
| 意大利忠利集团 | 30% |
| 中国电力财务有限公司 | 10% |

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2013 年 9 月 20 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 39 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券

投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，21年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理，1998年3月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999年10月起任公司董事长、党委书记。

庄乾志，董事，博士研究生，高级经济师。1999年8月至2004年12月在中国建设银行总行工作，历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005年1月至2007年7月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司重组办公室主任。2007年8月至2009年2月在西南证券有限责任公司任董事、党委委员及副总裁。2009年2月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任资本市场部负责人、战略部负责人，现任中国建银投资有限责任公司办公室（党办、董监办）主任。2012年4月起任公司董事。

林川，董事，博士研究生。2006年6月至2009年1月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009年2月至2009年7月在美国富升人寿保险任财务经理。2010年3月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部风险管理二组负责人。2012年4月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生。1991 年起历任 BARCLAYS BANK 金融分析师；1993 年起任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF) 首席执行官；2003 年起任 ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监；2004 年起任 GENERALI FINANCES SA 副总经理、投资总监；2007 年起任 GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A/GENERALI INVESTMENTS 首席执行官、投资总监；2009 年起任 GENERALI INVESTMENTS 董事会主席/首席执行官。2011 年起任 Generali Group 首席投资官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡) 主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano) 董事会成员等职务。2010 年 6 月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员（FCII）及英国特许保险师（Chartered Insurer）。1989 年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994 年起任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996 年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998 年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002 年起任中意人寿保险有限公司董事。2007 年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010 年 6 月起任公司董事。

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994 年 3 月至 2002 年 2 月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。2002 年 2 月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012 年 4 月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，20 年证券从业经历。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007 年 5 月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007 年 11 月起任公司董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993 年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001 年 5 月起任公司独立董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986 年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任国务院学位委

员会第六届学科评议组法学组成员、全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2010年6月起任公司独立董事。

刘秉升，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记；1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长；1985年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长；1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记；1995年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记；1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司独立董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11月起任公司独立董事。

2、监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科，高级工程师。1982年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师；1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005年1月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010年11月起任公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计核算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官、忠利集团兼并收购及企业融资部总监，并在 Generali Horizon S.p.A.，Trieste (IT)、BG Fiduciaria SIM 兼任董事会主席及 Autovie Venete S.p.A.、Banca Generali S.p.A.、Flandria (B)、Generali Investments Italy SGR S.p.A.，Trieste (IT)、Generali Investments SICAV (Lux)、Generali Finance B.V.，Diemen (NL)、Generali Investissement，Parigi (FR)、Genirland (IRL)、Generali Multinational Pension Solutions SICAV (Lux)、Graafschap Holland N.V.，Diemen (NL)、La Centrale Finanziaria Generale S.p.A.、Net Engineering International

S. p. A. , Padova (IT) 、 Perseo S. p. A. , Torino (IT) 、 Premuda S. p. A. , Genova (IT) 、 Transocean Holding Corporation (USA) 等公司兼任董事。2010 年 6 月起任公司监事。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。1986 年 7 月至 2000 年 3 月在中国人民解放军军事经济学院工作，历任教员、副主任。2000 年 4 月至 2003 年 1 月在长江证券有限责任公司工作，历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003 年 1 月至 2005 年 5 月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005 年 6 月起在中国电力财务有限公司工作，先后任金融租赁公司筹建处综合部主任，营业管理部主任助理，华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席，福建业务部副主任、主任，现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012 年 4 月起任公司监事。

沙骎，监事，硕士研究生。1998 年 5 月至 1999 年 11 月任职于国泰君安证券，1999 年 11 月至 2000 年 11 月任职于平安保险集团，2000 年 11 月至 2008 年 1 月任职于宝盈基金管理有限公司。2008 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任交易管理部总监、研究部总监。现任公司投资总监兼基金经理。2010 年 11 月起任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，2010 年 10 月至 2013 年 6 月任运营管理部负责人。现从事电子商务营销工作。2007 年 11 月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，20 年证券基金从业经历。1993 年 4 月至 1998 年 4 月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998 年 4 月至 2007 年 11 月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。2007 年 12 月加入国泰基金管理有限公司，2008 年 12 月起担任公司副总经理。

周向勇，硕士研究生，17 年金融从业经历。1996 年 7 月至 2004 年 12 月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004 年 12 月至 2011 年 1 月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012 年 11 月起任公司副总经理。

李志坚，硕士研究生，21 年金融业从业经历。1992 年 2 月至 1994 年 12 月在美国花旗银行台北分行工作，任财务企划助理；1995 年 1 月至 2000 年 12 月在台湾大华证券公司工作，

任债券交易总监；2001年1月至2004年9月在台湾景顺投信股份有限公司工作，负责投资业务；2004年10月至2006年5月在台湾保诚投信股份有限公司工作，负责投资业务；2006年6月至2010年4月在美国纽约人寿台湾子公司工作，任投资长；2010年5月至2012年12月在台湾富邦投信股份有限公司工作，任投资长；2013年1月起加入国泰基金管理有限公司，任全球投资总监，2013年6月起任公司副总经理。

林海中，硕士研究生，11年证券基金从业经历。2002年8月至2005年4月在中国证监会信息中心工作，历任专业助理、主任科员；2005年4月至2012年6月在中国证监会基金监管部工作，历任主任科员、副处长、处长。2012年6月加入国泰基金管理有限公司，2012年8月起任公司督察长。

4、本基金的基金经理

(1) 现任基金经理

张玮，男，硕士研究生，13年证券基金从业经历。2000年11月至2004年6月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004年7月至2007年3月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007年3月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长基金的基金经理助理，2008年5月起担任国泰金鹰增长证券投资基金的基金经理，2009年4月至2009年10月兼任国泰金盛封闭的基金经理，2009年10月起兼任国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理，2012年3月起兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理。2010年7月至2011年6月任研究部副总监，2011年6月起任研究部总监。2011年6月至2012年2月兼任公司投资副总监，2012年2月起兼任公司投资总监。

(2) 历任基金经理

本基金自基金合同生效以来，一直由张玮担任基金经理。

5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

李志坚先生：副总经理

周向勇先生：副总经理

黄焱先生：总经理助理

张则斌先生：投资总监

沙骎先生：投资总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

（四）基金管理人职责

- 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、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

（五）基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。
- 2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
 - (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谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

（六）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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（七）基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险，保证经营活动的合法合规和有效开展，制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施，形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面，并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。

（1）内部风险控制遵循的原则

- 1) 全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
- 2) 独立性原则：公司设立独立的稽核监察部，稽核监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；
- 3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；
- 4) 保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；
- 5) 定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

（2）内部会计控制制度

公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求，建立了完善的内部会计控制制度，实现了职责分离和岗位相互制约，确保会计核算的真实、准确、完整，并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立，保护基金资产的独立、安全。

（3）风险管理控制制度

公司为有效控制管理运营中的风险，建立了一整套完整的风险管理控制制度，其内容由一系列的具体制度构成，主要包括：岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程，对公司面临的投资风险和管理风险进行有效的控制。

（4）监察稽核制度

公司实行独立的监察稽核制度，通过对稽核监察部充分授权，对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核，确保公司

经营的合法合规性和内部控制的有效性。

2、基金管理人内部控制制度要素

（1）控制环境

公司经过多年的管理实践，建立了良好的控制环境，以保证内部会计控制和管理控制的有效实施，主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核职能等方面。

1) 公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

2) 在组织结构方面，公司设立的分管领导议事会议、总经理办公会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

3) 公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

4) 公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

（2）控制的性质和范围

1) 内部会计控制

公司建立了完善的内部会计控制，保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。

首先，公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则，制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计业务控制流程，做好基金业务和公司经营的核算工作，真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。

其次，公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开，保证两者相互独立，各基金之间做到独立建账、独立核算，保证基金资产和公司资产之间、以及各基金资产之间的相互独立性。

公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度，确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。

另外公司还建立了严格的财务管理制度，执行严格的预算管理和财务费用审批制度，加强成本控制和监督。

2) 风险管理控制

公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系，主要包括：

岗位分离和空间隔离制度：为保证各部门的相对独立性，公司建立了明确的岗位分离制度；同时实行空间隔离制度，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密；

投资管理业务控制：通过建立完整的研究业务控制、投资决策控制、交易业务控制，完善投资决策委员会的投资决策职能和风险控制委员会的风险控制职能，实行投资总监和基金经理分级授权制度和股票池制度，进行集中交易，以及稽核监察部对投资交易实时监控等，加强投资管理控制，做到研究、投资、交易、风险控制的相互独立、相互制约和相互配合，有效控制操作风险；建立了科学先进的投资风险量化评估和管理体系，控制投资业务中面临的市场风险、集中风险、流动性风险等；建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系，对投资管理的风险和业绩进行及时评估和反馈；

信息技术控制：为保证信息技术系统的安全稳定，公司在硬件设备运行维护、软件采购维护、网络安全、数据库管理、危机处理机制等方面均制定实施了完善的制度和控制流程；

营销业务控制：公司制定了完善的市场营销、客户开发和客户服务制度，以保证在营销业务中对有关法律法规的遵守，以及对经营风险的有效控制；

信息披露控制和资料保全制度：公司制定了规范的信息披露管理办法，保证信息披露的及时、准确和完整；在资料保全方面，建立了完善的信息资料保全备份系统，以及完整的会计、统计和各种业务资料档案；

独立的监察稽核制度：稽核监察部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

3) 内部控制制度的实施

公司风险控制委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度，对公司面临的主要风险进行辨识和评估，制定了风险控制原则。在风险控制委员会总体方针指导下，各部门根据各自业务特点，对业务活动中存在的风险点进行了揭示和梳理，有针对性地建立了详细的风险控制流程，并在实际业务中加以控制。

(3) 内部控制制度实施情况检查

公司稽核监察部在进行风险评估的基础上，对公司各业务活动中内部控制措施的实施情况进行定期和不定期的监察稽核，重点是业务活动中风险暴露程度较高的环节，以确保公司

经营合法合规、以及内部控制制度的有效遵循。

在确保现有内部控制制度实施情况的基础上，公司会根据新业务开展和市场变化情况，对内部控制制度进行及时的更新和调整，以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察部在对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上，也会重点对内部控制制度的有效性进行评估，并提出相应改进建议。

（4）内部控制制度实施情况的报告

公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程，各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部报告，使公司高级管理层和稽核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处理。

稽核监察部在对内部控制实施情况的监察中，对发现的问题均立即向公司高级管理层报告，并提出相应的建议，对于重大问题，则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部定期出具独立的监察稽核报告，直接报公司董事长和中国证监会。

3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度，切实维护基金份额持有人的合法权益。

四、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2012年9月30日，招商银行总资产3.1446万亿元人民币，核心资本充足率8.47%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2012年招商银行加大高收益托管产品营销力度，新增托管公募开放式基金13只，新增首发公募开放式基金托管规模433亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入6.54亿元，较上年增长28.17%，托管资产余额1.08万亿元，较年初增长112.85%。作

为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；三度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

（二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999 年 3 月开始担任本公司董事。2010 年 8 月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司(上海证券交易所上市公司)董事长，及中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司(深圳证券交易所上市公司)董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

田惠宇先生，本行主要负责人，执行董事，2013 年 5 月起担任本行主要负责人、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995 年 5 月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006 年 4 月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生，高级经济师。1993 年 10 月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011 年 7 月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2013 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现

金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(QDII-LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银保本二号混合型证券投资基金共67只开放式基金及其它托管资产，托管资产为16397.79亿元人民币。

（四）托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设合规管理委员会、风险控制委员会、审计管理委员会、信息规划委员会、服务监督管理委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5) 适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、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的修订和完善。

(6) 防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业

务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

(五) 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、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定、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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限期内纠正的，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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，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有重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管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，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

| 序号 | 机 构 名 称 | 机 构 信 息 | |
|-----------------------------------|------------------|---|--|
| 1 | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 地址：上海浦东世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼 | |
| 直销业务专用电话：021-38561759 | | | |
| 客户服务专线：400-888-8688, 021-38569000 | | | |
| 传真：021-68775881 | | 传真：021-68775881 | |
| 2 | 国泰基金管理有限公司北京直销柜台 | 地址：中国北京市西城区金融大街 7 号第 5 层 | |
| 电话：010-66553078 | | 传真：010-66553082 | |
| 联系人：吉·青珂莫 | | | |
| 3 | 国泰基金 电子交易平台 | 网站： www.gtfund.com 登录网上交易页面 | |
| 电话：021-38561841 | | 联系人：沈茜 | |

2、代销机构

（1）代销银行及券商

| 序号 | 机 构 名 称 | 机 构 信 息 | |
|--|--------------|--|--|
| 1 | 中国银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号 | |
| 法定代表人：田国立 | | 联系人：客户服务中心 | |
| 客服电话：95566 | | 网址： www.boc.cn | |
| 2 | 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：王洪章 | | 客服电话：95533 | |
| 网址： www.ccb.com | | | |
| 3 | 中国农业银行股份有限公司 | 注册地址：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 | | 客户服务电话：95599 | |
| 联系人：刘一宁 | | 传真：010-85109219 | |
| 网址： www.95599.cn | | | |
| 4 | 中国工商银行股份 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） | |

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| | 有限公司 | 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） | |
| | | 法定代表人：姜建清 | 电话：95588 |
| | | 网址： www.icbc.com.cn | |
| 5 | 交通银行股份有限公司 | 注册地址：上海市银城中路 188 号 | |
| | | 法定代表人：牛锡明 | 客服电话：95559 |
| | | 联系人：曹榕 | 电话：021-58781234 |
| | | 网址： www.bankcomm.com | |
| 6 | 招商银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| | | 法定代表人：傅育宁 | 联系人：邓炯鹏 |
| | | 电话：0755-83198888 | 传真：0755-83195109 |
| | | 客户服务热线：95555 | 网址： www.cmbchina.com |
| 7 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：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 |
| | | 联系人：高天、虞谷云 | 客户服务热线：95528 |
| | | 网址： www.spdb.com.cn | |
| 8 | 中国民生银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 | |
| | | 法定代表人：董文标 | 联系人：董云巍、吴海鹏 |
| | | 电话：010-58351666 | 传真：010-83914283 |
| | | 客服电话：95568 | 网址： www.cmbc.com.cn |
| 9 | 北京银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 | |
| | | 法定代表人：闫冰竹 | 联系人：谢小华 |
| | | 电话：010-66223587 | 传真：010-66226045 |
| | | 客服电话：010-95526 | |
| | | 网址： www.bankofbeijing.com.cn | |
| 10 | 上海农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号 | |
| | | 法定代表人：胡平西 | 联系人：吴海平 |
| | | 电话：021-38576977 | 传真：021-50105124 |
| | | 客服电话：021-962999 | 网址： www.srcb.com |

| | | | |
|----|--------------|--|--|
| 11 | 中国中投证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元 | |
| | | 法定代表人：龙增来 | 联系人：刘毅 |
| | | 电话：0755-82023442 | 客服电话：400-600-8008 |
| | | 网址： www.china-invs.cn | |
| 12 | 国泰君安证券股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区商城路618号 | |
| | | 法定代表人：万建华 | 联系人：芮敏祺 |
| | | 电话：021-38676161 | 传真：021-38670161 |
| | | 客服电话：400-888-8666 | 网址： www.gtja.com |
| 13 | 宏源证券股份有限公司 | 注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号 | |
| | | 法定代表人：冯戎 | 联系人：李巍 |
| | | 电话：010-88085858 | 传真：010-88085195 |
| | | 客服电话：400-800-0562 | 网址： www.hysec.com |
| 14 | 万联证券有限责任公司 | 注册地址：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 | 联系人：罗创斌 |
| | | 电话：020-38286651 | 传真：020-22373718-1013 |
| | | 客服电话：400-888-8133 | 网址： www.wlzq.com.cn |
| 15 | 中信建投证券股份有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 | |
| | | 法定代表人：王常青 | 联系人：魏明 |
| | | 电话：010-85130588 | 传真：010-65182261 |
| | | 客服电话：400-888-8108 | 网址： www.csc108.com |
| 16 | 海通证券股份有限公司 | 注册地址：上海市淮海中路98号 | |
| | | 法定代表人：王开国 | 联系人：李笑鸣 |
| | | 电话：021-23219000 | 传真：021-23219100 |
| | | 客服电话：400-888-8001（全国），021-95553 | |
| | | 网址： www.htsec.com | |
| 17 | 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 | |
| | | 法定代表人：陈有安 | 联系人：田薇 |
| | | 电话：010-66568430 | 传真：010-66568990 |

| | | |
|----|----------------|--|
| | | 客服电话：400-8888-888 |
| | | 网址： www.chinastock.com.cn |
| 18 | 中信证券（浙江）有限责任公司 | 注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 楼 |
| | | 法定代表人：沈强 联系人：周妍 |
| | | 电话：0571-86078823 客服电话：0571-96598 |
| | | 网址： www.bigsun.com.cn |
| 19 | 申银万国证券股份有限公司 | 注册地址：上海市常熟路 171 号 |
| | | 法定代表人：丁国荣 联系人：邓寒冰 |
| | | 电话：021-54033888 传真：021-54038844 |
| | | 客服电话：021-962505 网址： www.sw2000.com.cn |
| 20 | 东方证券股份有限公司 | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 |
| | | 法定代表人：潘鑫军 联系人：吴宇 |
| | | 电话：021-63325888 传真：021-63326173 |
| | | 客服电话：95503 网址： www.dfqzq.com.cn |
| 21 | 东吴证券股份有限公司 | 注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层 |
| | | 法定代表人：吴永敏 联系人：方晓丹 |
| | | 电话：0512-65581136 传真：0512-65588021 |
| | | 客服电话：0512-33396288 网址： www.dwzq.com.cn |
| 22 | 广发证券股份有限公司 | 注册地址：广州天河区天河北路 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 联系人：黄岚 |
| | | 电话：020-87555888 传真：020-87555305 |
| | | 客服电话：95575 网址： www.gf.com.cn |
| 23 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号 |
| | | 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼 |
| | | 法定代表人：曾小普 联系人：徐美云 |
| | | 电话：0791-6285337 传真：0791-6288690 |
| | | 网址： www.gsstock.com |

| | | | |
|----|--------------|---|--------------------|
| 24 | 民生证券股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层 | |
| | | 法定代表人：余政 | 联系人：赵明 |
| | | 电话：010-85127622 | 传真：010-85127917 |
| | | 客服电话：400-619-8888 | 网址：www.msyzq.com |
| 25 | 上海证券有限责任公司 | 注册地址：上海市西藏中路 336 号 | |
| | | 法定代表人：郁忠民 | 联系人：张瑾 |
| | | 电话：021-53519888 | 传真：021-53519888 |
| | | 客服电话：021-962518 | 网址：www.962518.com |
| 26 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号 | |
| | | 法定代表人：徐浩明 | 联系人：刘晨 |
| | | 电话：021-22169999 | 传真：021-22169134 |
| | | 客服电话：10108998、400-888-8788 | |
| | | 网址：www.ebscn.com | |
| 27 | 中信万通证券有限责任公司 | 注册地址：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 20 层（266061） | |
| | | 法定代表人：杨宝林 | 联系人：吴忠超 |
| | | 电话：0532-85022326 | 传真：0532-85022605 |
| | | 客服电话：0532-96577 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| | | 注册地址：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 | |
| 28 | 中信证券股份有限公司 | 法定代表人：王东明 | 联系人：陈忠 |
| | | 电话：010-84588888 | 传真：010-84865560 |
| | | 网址：www.cs.ecitic.com | |
| | | 注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| 29 | 华泰证券有限责任公司 | 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 | 联系人：张小波 |
| | | 电话：025-84457777 | 网址：www.htzq.com.cn |
| | | 客服电话：95597 | |
| 30 | 长江证券股份有限 | 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 | |

| | | | | |
|----|------------|--------------------------------------|----------------------|--|
| | 公司 | 法定代表人：胡运钊 | 联系人：李良 | |
| | | 电话：027-65799999 | 传真：027-85481900 | |
| | | 客服电话：95579 | 网址：www.95579.com | |
| 31 | 渤海证券股份有限公司 | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 | | |
| | | 办公地址：天津市河西区宾水道 8 号 | | |
| | | 法定代表人：杜庆平 | 联系人：王兆权 | |
| | | 电话：022-28451861 | 传真：022-28451892 | |
| | | 客服电话：400-651-5988 | 网址：www.bhzq.com | |
| 32 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 | | |
| | | 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层 | | |
| | | 法定代表人：菅明军 | 联系人：程月艳、耿铭 | |
| | | 电话：0371-65585670 | 传真：0371-65585665 | |
| | | 客服电话：400-813-9666/0371-967218 | | |
| | | 网址：www.ccnew.com | | |
| 33 | 国信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼 | | |
| | | 法定代表人：何如 | 联系人：齐晓燕 | |
| | | 电话：0755-82130833 | 传真：0755-82133952 | |
| | | 客服电话：95536 | 网址：www.guosen.com.cn | |
| 34 | 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 38-45 层 | | |
| | | 法定代表人：宫少林 | 联系人：黄健 | |
| | | 电话：0755-82943666 | 传真：0755-82943636 | |
| | | 网址：www.newone.com.cn | | |
| | | 客服电话：400-888-8111\95565 | | |
| 35 | 齐鲁证券有限公司 | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | | |
| | | 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | | |
| | | 法定代表人：李玮 | 联系人：吴阳 | |
| | | 电话：0531-68889155 | 传真：0531-68889752 | |
| | | 客服电话：95538 | 网址：www qlzq com cn | |

| | | | |
|----|------------|--|--|
| 36 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 | |
| | | 法定代表人：牛冠兴 | 联系人：陈剑虹 |
| | | 联系电话：0755-82825551 | 传真：0755-82558355 |
| | | 客服电话：400-800-1001 | 网址： www.essence.com.cn |
| 37 | 恒泰证券股份有限公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号 | |
| | | 法定代表人：庞介民 | 联系人：王旭华 |
| | | 电话：0471-4972343 | 传真：0471-4961259 |
| | | 客服电话：0471-4961259 | 网址： www.cnht.com.cn |
| 38 | 厦门证券有限公司 | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼 | |
| | | 法定代表人：傅毅辉 | 联系人：卢金文 |
| | | 电话：0592-5161642 | 传真：0592-5161140 |
| | | 客服电话：0592-5163588 | 网址： www.xmzq.cn |
| 39 | 华宝证券有限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层 | |
| | | 法定代表人：陈林 | 联系人：刘闻川 |
| | | 电话：021-68778081 | 传真：021-68778117 |
| | | 客服电话：400-820-9898 | 网址： www.cnhbstock.com |
| 40 | 中国国际金融有限公司 | 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 | |
| | | 法定代表人：李剑阁 | 联系人：罗文雯 |
| | | 电话：010-65051166 | 传真：010-65051156 |
| | | 网址： www.cicc.com.cn | |
| 41 | 华福证券有限责任公司 | 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层 | |
| | | 法定代表人：黄金琳 | 联系人：张腾 |
| | | 电话：0591-87278701 | 传真：0591-87841150 |
| | | 客服电话：0591-96326 | 网址： www.hfzq.com.cn |
| 42 | 天相投资顾问有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 | |
| | | 法定代表人：林义相 | 联系人：林爽 |
| | | 电话：010-66045608 | 传真：010-66045527 |
| | | 客服电话：010-66045678 | 网址： www.txsec.com |

| | | | |
|----|--------------|--|--|
| 43 | 信达证券股份有限公司 | 注册地址：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 | 联系人：唐静 |
| | | 电话：010-88656100 | 传真：010-88656290 |
| | | 客服电话：400-800-8899 | 网址： www.cindasc.com |
| 44 | 中国民族证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层 | |
| | | 法定代表人：赵大建 | 联系人：李微 |
| | | 电话：010-59355941 | 传真：010-66553791 |
| | | 客服电话：400-889-5618 | 网址： www.e5618.com |
| 45 | 华龙证券有限责任公司 | 注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号 | |
| | | 法定代表人：李晓安 | 联系人：李昕田 |
| | | 电话：0931-8888088 | 传真：0931-4890515 |
| | | 客服电话：0931-4890100、4890619、4890618 | |
| | | 网址： www.hlzqgs.com | |
| 46 | 国元证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 | |
| | | 法定代表人：凤良志 | 联系人：祝丽萍 |
| | | 电话：0551-2257012 | 传真：0551-2272100 |
| | | 客服电话：95578 | 网址： www.gyzq.com.cn |
| 47 | 渤海银行股份有限公司 | 注册地址：天津市河西区马场道201-205号 | |
| | | 法定代表人：刘宝凤 | 联系人：王宏 |
| | | 电话：022-58316666 | 传真：022-58316259 |
| | | 客服电话：400-888-8811 | 网址： www.cbhb.com.cn |
| 48 | 青岛银行股份有限公司 | 注册地址：青岛市市南区香港中路68号华普大厦 | |
| | | 法定代表人：郭少泉 | 联系人：滕克 |
| | | 电话：0532-85709732 | 传真：0532-85709725 |
| | | 客服电话：96588（青岛）400-669-6588（全国） | |
| | | 网址： www.qdccb.com | |
| 49 | 平安证券有限责任公司 | 注册地址：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 | 联系人：郑舒丽 |
| | | 电话：0755-22626391 | 传真：0755-82400862 |
| | | 客服电话：95511-8 | 网址： www.pingan.com |

| | | | |
|----|----------------|------------------------------------|-----------------------|
| 50 | 德邦证券有限责任公司 | 注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 | |
| | | 法定代表人：姚文平 | 联系人：罗芳 |
| | | 电话：021-68761616 | 传真：021-68767981 |
| | | 客服电话：4008888128 | 网址：www.tebon.com.cn |
| 51 | 中航证券有限公司 | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 | |
| | | 法定代表人：杜航 | 联系人：戴蕾 |
| | | 电话：0791-86768681 | 传真：0791-86770178 |
| | | 客服电话：400-8866-567 | 网址：www.avicsec.com |
| 52 | 洛阳银行股份有限公司 | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口 | |
| | | 法定代表人：王建甫 | 联系人：胡艳丽 |
| | | 电话：0379-65921977 | 传真：0379-65920155 |
| | | 客服电话：0379-96699 | |
| | | 网址：www.bankofluoyang.com.cn | |
| 53 | 东海证券有限责任公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼 | |
| | | 法定代表人：朱科敏 | 联系人：李涛 |
| | | 电话：0519-88157761 | 传真：0519-88157761 |
| | | 客服电话：400-888-8588 | 网址：www.longone.com.cn |
| 54 | 山西证券股份有限公司 | 注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 | |
| | | 法定代表人：侯巍 | 联系人：郭熠 |
| | | 电话：0351-8686659 | 传真：0351-8686619 |
| | | 客服电话：400-666-1618、95573 | |
| | | 网址：www.i618.com.cn | |
| 55 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦 | |
| | | 法定代表人：李伟 | 联系人：王璇 宋永成 |
| | | 电话：0755-25188269 | 传真：0755-25188785 |
| | | 客服电话：4001961200 | 网址：www.4001961200.com |
| 56 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区月坛北街26号 | |
| | | 法定代表人：宋德清 | 联系人：黄恒 |
| | | 电话：010-58568235 | 传真：010-58568062 |

| | | | |
|----|--------------|---|--|
| | | 客服电话：010-58568118 | 网址： www.hrsec.com.cn |
| 57 | 江海证券有限公司 | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 | |
| | | 法定代表人：孙名扬 | 联系人：张宇宏 |
| | | 电话：0451-82336863 | 传真：0451-82287211 |
| | | 客服电话：400-666-2288 | 网址： www.jhzq.com.cn |
| 58 | 广州证券有限责任公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼，20 楼 | |
| | | 法定代表人：刘东 | 联系人：林洁茹 |
| | | 电话：020-88836655 | 传真：020-88836654 |
| | | 客服电话：020-961303 | 网址： www.gzs.com.cn |
| 59 | 天源证券经纪有限公司 | 注册地址：青海省西宁市长江路 53 号 | |
| | | 法定代表人：林小明 | 联系人：王斌 |
| | | 电话：0755-33331188 | 传真：0755-33329815 |
| | | 客服电话：4006543218 | 网址： www.tyzq.com.cn |
| 60 | 浙商证券股份有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 | |
| | | 法定代表人：吴承根 | 联系人：毛亚莉 |
| | | 电话：021-64318893 | 传真：021-64713795 |
| | | 客服电话：967777 | 网址： www.stocke.com.cn |
| 61 | 新时代证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层 | |
| | | 法定代表人：马金声 | 联系人：孙恺 |
| | | 电话：010-83561149 | 传真：010-83561094 |
| | | 客服电话：4006989898 | 网址： www.xsdzq.cn |
| 62 | 西南证券股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号 | |
| | | 法定代表人：余维佳 | 联系人：张煜 |
| | | 电话：023-63786141 | 传真：023-63786212 |
| | | 网址： http://www.swsc.com.cn | |
| 63 | 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：许刚 | 联系人：王炜哲 |
| | | 电话：021-20328309 | 传真：021-50372474 |
| | | 客服电话：4006208888 | 网址： www.bocichina.com |
| 64 | 哈尔滨银行股份有 | 注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 | |

| | | | |
|----|---|--|--|
| | 限公司 | 法定代表人：郭志文 | 联系人：武艳凤 |
| | | 电话：0451-86779018 | 传真：0451-86779218 |
| | 客服电话：95537/400-60-95537 | | |
| | 网址： http://www.hrbcb.com.cn | | |
| 65 | 国都证券有限责任公司 | 注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 | |
| | | 法定代表人：常喆 | 联系人：黄静 |
| | | 电话：010-84183333 | 传真：010-84183311-3389 |
| | | 客服电话：4008188118 | 网址： www.guodu.com |
| 66 | 包商银行股份有限公司 | 注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号 | |
| | | 法定代表人：李镇西 | 法定代表人：刘芳 |
| | | 电话：0472-5189051 | 电话：0472-5189057 |
| | | 客服电话：96016（北京、内蒙古地区） | |
| | | 网址： www.bsb.com.cn | |
| 67 | 东莞农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号 | |
| | | 法定代表人：何沛良 | 联系人：何茂才 |
| | | 电话：0769-22866255 | 电话：0769-22866255 |
| | | 客服电话：0769-961122 | 网址： www.drcbank.com |
| 68 | 开源证券有限责任公司 | 注册地址：西安市锦业路1号都市之门B座5层 | |
| | | 法定代表人：李刚 | 联系人：王姣 |
| | | 电话：029-68633210 | 客服电话：400-860-8866 |
| | | 网址： www.kysec.cn | |

(2) 第三方销售机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | | |
|----|----------------------|--|-----------------|--|
| 1 | 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室 | | |
| | | 法定代表人：汪静波 | | |
| | | 联系人：方成 | | |
| | | 电话：021-38602377 | | |
| 2 | 上海好买基金销售有限公司 | 客服电话：4008215399 | | |
| | | 网址： www.noah-fund.com | | |
| | | 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室 | | |
| | | 法定代表人：杨文斌 | 联系人：王玉山 | |
| | | 电话：021-58870011 | 传真：021-68596916 | |

| | | | |
|---|------------------|---|--|
| | | 客服电话：400-700-9665 | 网址： www.ehowbuy.com |
| 3 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 | |
| | | 法定代表人：张跃伟 | 联系人：敖玲 |
| | | 电话：021-58788678-8201 | 传真：021—58787698 |
| | | 客服电话：400-089-1289 | 网址： www.erichfund.com |
| 4 | 深圳众禄基金销售有限公司 | 注册地址：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 | 联系人：童彩平 |
| | | 电话：0755-33227950 | 传真：0755-82080798 |
| | | 客服电话：4006-788-887 | |
| | | 网址： www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com | |
| 5 | 北京展恒基金销售有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 | |
| | | 法定代表人：闫振杰 | 联系人：焦琳 |
| | | 电话：010-62020088-8288 | 传真：010-62020088-8802 |
| | | 客服电话：4008886661 | 网址： www.myfund.com |
| 6 | 浙江同花顺基金销售公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903 | |
| | | 法定代表人：凌顺平 | 联系人：杨翼 |
| | | 电话：0571-88911818-8565 | 传真：0571-86800423 |
| | | 客服电话：4008-773-776 0571-88920897 | |
| | | 网址： www.5ifund.com | |
| 7 | 杭州数米基金销售有限公司 | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号 | |
| | | 法定代表人：陈柏青 | 联系人：周嬿旻 |
| | | 电话：0571-28829790 | 传真：0571-26698533 |
| | | 客服电话：4000-766-123 | 网址： www.fund123.cn |
| 8 | 江苏金百临投资咨询有限公司 | 注册地址：无锡市滨湖区锦溪路99号 | |
| | | 法定代表人：费晓燕 | 联系人：袁丽萍 |
| | | 电话：0510-82758877 | 传真：0510-88555858 |
| | | 客服电话：0510-9688988 | 网址： www.jsjbl.com |
| 9 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 | |
| | | 法定代表人：其实 | 联系人：朱钰 |
| | | 电话：021-54509988-1071 | 传真：021-64383798 |

| | | | |
|----|------------------|-------------------------------|------------------------|
| | | 客服电话：4001818188 | 网址：www.1234567.com.cn |
| 10 | 万银财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：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 | 联系人：刘媛 |
| | | 电话：010-59393923 | 传真：010-59393074 |
| | | 客服电话：4008080069 | 网址：www.wy-fund.com |
| 11 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室 | |
| | | 法定代表人：盛大 | 联系人：叶志杰 |
| | | 电话：021-50583533 | 传真：021-50583633 |
| | | 客服电话：400-005-6355 | 网址：www.leadfund.com.cn |
| 12 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室 | |
| | | 法定代表人：齐凌峰 | 联系人：阮志凌 |
| | | 电话：010-82151989 | 传真：010-82158830 |
| | | 客服电话：400-158-5050 | 网址：www.9ifund.com |
| 13 | 浙江金观诚财富管理有限公司 | 注册地址：杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区801 | |
| | | 法定代表人：陆彬彬 | 联系人：鲁盛 |
| | | 电话：0571-56028617 | 传真：0571-56899710 |
| | | 客服电话：400-068-0058 | |
| | | 网址：www.jincheng-fund.com | |
| 14 | 宁波银行股份有限公司 | 注册地址：宁波市江东区中山东路294号 | |
| | | 法定代表人：陆华裕 | |
| | | 客服电话：96528（上海地区962528） | |
| | | 网址：www.nbcb.com.cn | |
| 15 | 杭州联合农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市建国中路99号 | |
| | | 法定代表人：张晨 | 联系人：仇侃宁 |
| | | 电话：0571-87923225 | 传真：0571-87923214 |
| | | 客服电话：96592 | 网址：www.urcb.com |

（二）注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

法定代表人：陈勇胜

联系人：何晔

传真：021-38561800

客户服务专线：400-888-8688，021-38569000

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传 真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：魏佳亮

经办注册会计师：汪棣、屈斯洁

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，并经中国证监会证监许可【2011】2129 号文核准，自 2012 年 2 月 16 日起向社会公开募

集，于2012年3月16日结束本基金的募集工作。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的净认购金额为409,260,367.49元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计26,377.01元人民币。上述资金已于2012年3月20日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的国泰成长优选股票型证券投资基金托管专户。

（二）基金类型和存续期限

- 1、基金类型：股票型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于2012年3月20日正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定的代销机构另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

- 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

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、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回、转换的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额申购、赎回价格以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”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

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内撤销。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下，可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内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、申购和赎回申请的确认与通知

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内(包括该日)对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时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。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付的方式与时间

申购采用全额缴款方式，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销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及相关销售机构在T+7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。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。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整并依照《信息披露办法》等有关规定在指定媒体上公告。

(五) 申购和赎回的金额

1、申购金额的限制

投资人单笔申购的最低金额为1,000.00元(含申购费)。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份数为1000.00份，若某基金份额持有人赎回时在销售网点保有的基金份额不足1000.00份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

5、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒

体上公告并报中国证监会备案。

（六）申购和赎回的费用

1、申购费用

(1) 申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) 申购费率

本基金的前端申购费率最高不高于 1.5%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

| 申购金额 (M) | 前端申购费率 |
|----------------------|-----------|
| $M < 50$ 万 | 1.5% |
| $50 \leq M < 200$ 万 | 1.2% |
| $200 \leq M < 500$ 万 | 0.8% |
| $M \geq 500$ 万 | 每笔 1000 元 |

2、赎回费用

(1) 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2) 赎回费率

本基金的赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，赎回费率如下：

| 赎回申请份额持有时间 (N) | 赎回费率 |
|------------------|------|
| $N < 1$ 年 | 0.5% |
| $1 \leq N < 2$ 年 | 0.2% |
| $N \geq 2$ 年 | 0 |

(注：赎回申请份额持有时间的计算，以该份额在注册登记机构的注册登记日开始计算。
1 年为 365 天，2 年为 730 天，依此类推)

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反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，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期

或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、申购份额的计算

(1) 申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

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

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

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

(2) 申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例，某投资人投资5,000元申购本基金，对应费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.128元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.5\%) = 4,926.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,926.11 / 1.128 = 4,367.12 \text{ 份}$$

投资人投资5,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.128元，则可得到4,367.12份基金份额。

4、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

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

赎回费用=赎回金额×相应的赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例：某投资人赎回 10,000 份基金份额，假设该份额的持有时间为 1 年 5 个月，赎回当日基金份额净值为 1.250 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.250=12,500.00 元

赎回费用=12,500×0.2%=25.00 元

净赎回金额=12,500-25.00=12,475.00 元

5、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可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无法正常运作。

2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。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。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。
- 4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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并予以公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日的基金总份额的 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延期赎回。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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上一日基金总份额的 10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续2日以上(含本数)发生巨额赎回，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，并应当在指定媒体上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者基金管理人网站在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告，并向中国证监会备案。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

(十二) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。

(十三) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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；捐赠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社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的规定办理，受理非交易过户申请的销售机构可按规定标准收取过户费用。

（十四）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十六）基金的冻结和解冻

注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分所产生的权益按照法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求决定是否冻结。

当基金份额处于冻结状态时，注册登记机构或其他机构有权拒绝该部分基金份额的赎回、转出、非交易过户以及基金的转托管申请。

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金通过精选具有较高成长性和良好基本面的优质企业，结合估值因素对投资组合进行积极管理。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%，其中投资于成长型企业的资

产不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，基金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%。

（三）投资策略

本基金侧重成长型企业的选取，在强调安全边际的前提下，追求收入与利润的持续增长。本基金成长型企业界定为最近三年主营业务收入增长率、最近三年净利润增长率或最近一年净资产收益率高于行业或市场平均水平的上市公司，或因公司基本面发生重大改变（如资产注入、并购、主营业务变更等）而具有潜在主营业务收入、净利润或净资产收益率快速增长趋势的上市公司。

1、大类资产配置

本基金运用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），通过宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关因素的分析判断，采用评分方法确定大类资产配置比例。

2、股票投资策略

本基金采用积极主动的投资管理策略，通过以下几个方面优选成长型股票：（1）企业经营方面，关注收入和利润的快速成长性；（2）通过调研分析了解财务数据背后成长的原因，并探寻成长的持续性，选择有核心竞争力的成长企业；（3）看重估值偏低的股票，寻找估值与成长性相匹配的标的，从而得到安全边际。在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，完成本基金投资组合的构建。

（1）通过定量分析筛选本基金的备选股票池

本基金首先通过企业成长性和成长质量等定量指标初步筛选出成长潜力较大的上市公司作为本基金的备选池。采用的具体财务指标主要包括主营业务收入增长率、净利润增长率和净资产收益率 ROE，选取主营业务收入增长率、净利润增长率或净资产收益率 ROE 高于行业或市场平均水平的上市公司作为初选股票。

主营业务收入增长率可以用来判断公司发展所处的阶段，主营业务收入增长率高，表明公司产品的市场需求大，业务扩张能力强，公司处于成长期。净利润的增长是公司成长性的基本特征，较高的净利润增长率表明公司经营业绩突出，市场竞争能力强。净资产收益率反映股东权益的收益水平，用以衡量公司运用自有资本的效率。本基金管理人认为，企业过往的成长性和盈利状况能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力，通过前述定量指标的综合运用，可甄别出收入与利润具有持续增长潜力的成长型企业。

（2）通过调研分析了解财务数据背后快速成长的原因，并探寻快速成长的持续性，选择

有核心竞争力的成长企业，构成本基金的成长股票池

针对备选股票池中的股票，进一步进行实地调研和深入研究，通过对决定主营业务收入、净利润增长、净资产收益率 ROE 的驱动因素的归因分析，从技术创新能力、企业商业模式、资源储备、市场竞争力、风险抵御能力、法人治理结构等多角度研判上市公司成长的质量和持续性，对于已经或将要发生资产注入、并购、主营业务变更等重大变化的，还要分析该重大变化是否给上市公司带来有利发展机遇和成长动力。

对于不在备选股票池中的上市公司，本基金管理人通过实地调研和案头分析，发现符合本基金的成长性要求的，可以纳入本基金的成长股票池。

A、技术创新能力

通过对上市公司的产品自主创新情况、主要产品更新周期、专有技术和专利、对引进技术的吸收和改进能力等指标进行考察和分析，进而对公司的技术创新能力进行判断。

B、商业模式优势

公司商业模式和经营理念决定了公司在其所属行业中发展的潜力和方向，本基金管理人分析上市公司是否具有领先的商业模式和经营理念，以及该公司是否因此能有效配置各种生产要素，形成一个完整的高效率的具有独特核心竞争力的运行系统。

C、资源储备优势

通过对公司的规模、政策扶持程度、成本、进入壁垒、国内外同行比较和垄断性等指标进行考察和分析，进而判断公司的资源优势是否支持其持续成长。分析上市公司所拥有的资源储备情况、资源可持续开发情况以及资源储备水平在同行业中的地位。

D、市场竞争力优势

分析上市公司是否在经营许可、品牌、资源、技术和成本控制等方面具有竞争对手在中长期内难以赶超的显著优势，是否拥有出色的销售机制、体系及团队。

E、风险抵御能力

分析上市公司的财务状况是否稳健，是否能够抵御财务风险；分析上市公司产品是否满足市场需求，是否能够抵御市场风险；分析上市公司管理团队是否具有较强的管理能力并足以抵御经营风险。

F、法人治理结构

分析上市公司法人治理结构是否完善，并在公司的日常运营中有效发挥作用。

G、重大事项变化

分析上市公司基本面是否已经发生或即将发生资产注入、并购、技术创新、产品创新、股东变换、主营业务变更等重大变化，以及该重大变化能否给上市公司带来有利发展机遇和成长动力。

（3）在成长股票池范围内，本基金利用价值评估分析，形成可投资的股票组合。价

值评估分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括 PEG、市盈率法、市净率法、市销率、EV/EBITDA、股息贴现模型等方法。基金管理人将综合运用 PEG、PE、PB、PS 等估值指标，以在相对风险可控的情况下，寻找合理的、可持续增长的企业。

(4) 实地调研：对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入分析企业的核心竞争力，如企业模式、管理团队能力，以及企业经营状况和财务数据的真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴，以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。

3、债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

(1) 考虑标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值；

(2) 计算权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，为权证的具体操作提供依据。

5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

(1) 时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

(2) 期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约；运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸；对套期保值的现货标的 Beta

值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。

（3）展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展仓。

（4）保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

（5）投资组合管理策略

本基金建仓时，将根据市场环境，运用股指期货管理建仓成本。

本基金出现较大申购赎回时，将运用股指期货管理组合的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

未来，随着中国证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，基金可相应调整和更新相关投资策略。

（四）投资限制

1、组合限制

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

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(6) 本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%—95%，其中投资于成长型企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%；

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(9) 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%;

(10) 本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%;

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(14) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、中期票据等。

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即为基金资产的 60%-95%；

(19) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(20) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(21) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等

事宜另行具体协商。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（五）业绩比较基准

业绩比较基准 = 沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%

本基金为股票型基金。在综合考虑了基金股票组合的构建、投资标的以及市场上可得的股票指数的编制方法后，本基金选择市场认同度较高并且作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映A股市场总体发展趋势。债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数，中证综合债券指数是综

合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为股票型基金，股票型基金的风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的品种。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、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；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 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。

（八）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

（九）基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 7 月 16 日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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2013 年 6 月 30 日。

1、报告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 | 52,104,618.60 | 87.82 |
| | 其中：股票 | 52,104,618.60 | 87.82 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,748,998.47 | 11.38 |
| 7 | 其他各项资产 | 477,742.91 | 0.81 |
| 8 | 合计 | 59,331,359.98 | 100.00 |

2、报告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 | 1,210,300.00 | 2.10 |
| C | 制造业 | 26,069,006.35 | 45.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供 | - | - |
| E | 建筑业 | 8,470,600.00 | 14.72 |
| F | 批发和零售业 | 6,357,062.25 | 11.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,224,400.00 | 2.13 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,881,000.00 | 11.95 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 0 | 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 | 1,892,250.00 | 3.29 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 52,104,618.60 | 90.52 |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 600335 | 国机汽车 | 550,395 | 6,357,062.25 | 11.04 |
| 2 | 300058 | 蓝色光标 | 130,000 | 5,421,000.00 | 9.42 |
| 3 | 300147 | 香雪制药 | 234,000 | 3,926,520.00 | 6.82 |
| 4 | 601117 | 中国化学 | 300,000 | 2,856,000.00 | 4.96 |
| 5 | 300043 | 星辉车模 | 260,000 | 2,766,400.00 | 4.81 |
| 6 | 300055 | 万邦达 | 70,000 | 2,737,000.00 | 4.75 |
| 7 | 600572 | 康恩贝 | 238,500 | 2,644,965.00 | 4.59 |
| 8 | 002140 | 东华科技 | 100,000 | 2,481,000.00 | 4.31 |
| 9 | 000731 | 四川美丰 | 280,000 | 2,326,800.00 | 4.04 |
| 10 | 000049 | 德赛电池 | 33,040 | 1,982,400.00 | 3.44 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

9、投资组合报告附注

(1) 本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受到公开谴责、处罚的情况。

(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情况。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 29,724.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,450.84 |
| 5 | 应收申购款 | 446,567.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 477,742.91 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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 | 600335 | 国机汽车 | 6,357,062.25 | 11.04 | 重大资产重组 |
|---|--------|------|--------------|-------|--------|

十、基金的业绩

本基金业绩截止日为 2013 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，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。

| 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 |
|--------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2012 年 3 月 20 日至 2012 年 12 月 31 日 | -3.20% | 0.92% | -2.48% | 0.96% | -0.72% | -0.04% |
| 2013 年上半年 | 14.26% | 1.49% | -9.77% | 1.20% | 24.03% | 0.29% |
| 2012 年 3 月 20 日至 2013 年 6 月 30 日 | 10.60% | 1.16% | -12.01% | 1.05% | 22.61% | 0.11% |

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

（三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构

和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）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。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、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十二、基金资产的估值

（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）具体投资品种估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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) 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（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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。

4、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。

5、股指期货以估值日的结算价估值；如该估值日为非交易日，以最近一日的结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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。

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、股指期货、其它投资等金融资产和金融负债。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。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。基金管理人每个工作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）估值错误的确认与处理

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 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

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、或注册登记机构、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当事人（“受损方”）的直接损失按下述“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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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，则该当事人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返还不当得利的权利；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。基金管理人和基金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，由责任方承担。但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分及追偿费用可列入基金费用项下的相关科目，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直接损失。

(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，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，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、通报基金托管人并报中国证监会备案。
- (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交易时；
- 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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；
- 4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（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或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作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估值方法的第 6 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，或由于证券交易所或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、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

十三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。其中，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每一基金份额享有同等收益分配权；
- 2、基金收益分配后基金份额净值不能低于初始募集面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配4次，每次每单位基金份额收益分配比例不得低于收益分配基准日每单位基金份额可供分配利润的10%；
- 5、基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式；
- 6、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费时，注册登记机构可将投资人的现金

红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体上公告。法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配的时间和程序

- 1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
- 2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。
- 3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

十四、基金的费用与税收

（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、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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，基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金合同生效前的相关费用不得从基金财产中列支。基金管理人与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。

（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降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》

的规定在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十五、基金的会计和审计

（一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人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书面确认。

（二）基金的审计

- 1、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及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。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。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

十六、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

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。

公开披露的基金信息包括：

（一）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。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 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、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（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）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；
2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；
3、基金管理人将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。
基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（六）基金份额申购、赎回价格公告

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

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

4、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。

5、基金定期报告应当按有关规定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）临时报告与公告

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及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；

- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

（九）澄清公告

在基金合同存续期限内，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。

（十）基金份额持有人大会决议

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

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

（十一）中国证监会规定的其他信息

（十二）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十七、风险揭示

（一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资人心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益的不确定性。市场风险主要包括：

- 1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。
- 2、经济周期风险。随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。基金投资于债券与上市公司的股票，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。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。
- 5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

（三）流动性风险

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现收益而进行组合调整时，可能由于市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资人的赎回，基金管理人的现金支付出现困难，被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使基金净值受到不利影响。

（四）其他风险

除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：

- 1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；
- 2、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险；
- 3、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响；
- 4、因为业务竞争压力可能产生的风险；
- 5、因其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等会导致基金资产损失，影响基金收益水平。

（五）本基金的特有风险

一方面，本基金为股票型基金，股票投资比例不低于60%，受股票市场系统性风险影响较大。另一方面，由于本基金主要投资于成长型股票，成长型股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。成长型股票的投资收益会受到宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险，可能造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。此外，由于本基金还可以投资其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

- 1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。
 - (1) 转换基金运作方式；
 - (2) 变更基金类别；
 - (3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；

- (4) 变更基金份额持有人大会程序；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (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重大变化；
- (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、关于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，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在指定媒体公告。

（二）基金合同的终止

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

（三）基金财产的清算

- 1、基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(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。

2、基金财产清算程序

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。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1) — (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于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

组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

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。

十九、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- (1) 自本基金合同生效日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (3) 发售基金份额；
- (4) 依照有关规定为基金利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率、管理费率和赎回费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家有关规定，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投资者的利益；
- (7) 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；
- (8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (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) 自本基金合同生效日起，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运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- (1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效日起，依法保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、季度、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；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于15年；
- (10) 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；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (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管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (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、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (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) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行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、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

7、基金合同当事各方的权利义务以基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、召开事由

- (1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10) 单独或合计持有本基金基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

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

3、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。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，

应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

(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。

4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- 6) 代理投票的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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见

的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

5、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、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。
- 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，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
- 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) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

5) 会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；
- 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注册登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 25 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2) 通讯开会方式

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，在表决截止日前公布 2 次相关提示性公告；
- ②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)

到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③召集人在监督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，监督人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

6、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会议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。

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

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) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，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。法律法规另有规定的除外。

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,应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。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,经讨论后进行表决,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的,其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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

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)、身份证件号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、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日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

(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。

7、决议形成的条件、表决方式、程序

(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(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效,除下列2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

2) 特别决议

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

(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) 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) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

8、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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(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。关于本章第 2 条所规定的第 1)-10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第 2 条所规定的第 11)、12)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

2、基金财产的清算

(1) 基金财产清算组

- 1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
- 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。

（2）基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

（3）清算费用

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

（4）基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款1) -3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于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；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

（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。

（四）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，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。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

（五）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

二十、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：国泰基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

邮政编码：200120

法定代表人：陈勇胜

成立时间：1998 年 3 月 5 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基字[1998]5 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿壹仟万元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；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。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

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，对基金投资范围、投资对象进行监督。

（1）本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

（2）本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书

面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投融资比例：

股票资产占基金资产的 60%—95%，其中投资于成长型企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%，其中，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，基金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%。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%—95%，其中投资于成长型企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%；
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9) 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%；
- (10) 本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%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

(14) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、中期票据等。

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即为基金资产的60%-95%；

(19) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(20) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(21) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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

有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算。基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

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。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定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。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个交易日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通

知》、《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》等有关法律法规规定。

(1) 本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

(2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

(3) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指

令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

(4) 基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

6、基金管理人应本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人依据法律法规、监管部门的规定制定经公司董事会批准的《基金投资中期票据决策与风险管理制度》(包含流动性风险处置预案)，以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制和流动性风险处置。基金托管人按照基金合同及本协议中固定收益类的投资比例和相应限制对基金管理人投资中期票据进行监督。

7、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定、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、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，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限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

9、基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

10、若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及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

11、基金管理人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1、基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

3、基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

4、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

(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与独立。

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。

未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基

金托管人不承担。

(6) 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，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。

(8) 资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益；由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

(9) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，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，基金管理人应将募集到的基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，基金管理人应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名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

(1) 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，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

(2) 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。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅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或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 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，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 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，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本合同的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

(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、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构

及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

8、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、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

（五）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

3、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，仍无法达成一致意见的，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。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，

不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和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

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，仲裁地点为深圳市，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。仲裁裁决是终局的，对当事人都有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的修改与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2、基金托管协议终止出现的情形

- (1) 基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十一、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，基金管理人可根据基金份额持有人的需要和市场的变化，不断完善并增加、修改这些服务项目：

（一）客户服务专线

1、理财咨询

人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。

2、全天候的7×24小时电话自助查询（基金净值、账户信息、公司介绍、产品介绍、交

易费率等)。

3、 7×24 小时留言信箱。若不在人工服务时间或座席繁忙，可留言，基金管理人会尽快在 2 个工作日内回电。

（二）客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

（三）短信服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的手机短信资讯。内容包括基金净值、交易确认、手机月度对账单、生日节日祝福、相关基金资讯信息以及移动资讯刊物等。

（四）资料寄送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的纸制资讯。在获取准确的邮政地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责向订制客户寄送以下资料：

1、基金投资者对账单

基金投资者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，在每季度结束后 1 个月内向有交易的订制持有人以书面形式寄送，若投资者在季度期内无交易发生，基金注册登记人不邮寄该季度对账单，年度对账单在每年度结束后 1 个月内对所有订制持有人以书面形式寄送。

2、其他相关的信息资料。

（五）电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向订制邮件服务的投资人发送电子资讯和电子月度交易对账单等。

（六）联系基金管理人

1、网址：www.gtfund.com

- 2、电子邮箱：service@gtfund.com
- 3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-38569000
- 4、客户服务传真：021-38561700
- 5、基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 邮编：200120

二十二、其他应披露事项

| 公告名称 | 报纸 | 日期 |
|--|-------------------------------|------------|
| 关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-03-22 |
| 国泰基金管理有限公司关于开通通联支付工商银行、中国银行和民生银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-01 |
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-01 |
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-17 |
| 国泰基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户网上直销定投业务并实施费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-23 |
| 关于新增东莞农村商业银行、广州农村商业银行代理销售国泰基金旗下部分产品并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-24 |
| 国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-04-26 |
| 关于新增宁波银行代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-05-04 |
| 关于新增北京万银财富投资有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-05-31 |
| 国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-05-31 |
| 关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海利得基金销售有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-18 |

| | | |
|--|-------------------------------|------------|
| 关于新增上海利得基金销售有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-18 |
| 国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-25 |
| 关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-29 |
| 关于新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-29 |
| 国泰基金管理有限公司关于在好买基金开通旗下基金定期定额业务及参加定投网上交易申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-06-29 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金继续参加交通银行网上银行申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-03 |
| 国泰基金管理有限公司关于网上交易平台支持港澳台居民开立证券投资基金账户的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-10 |
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-10 |
| 国泰基金管理有限公司关于开通通联支付汉口银行借记卡与大连银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-18 |
| 国泰基金管理有限公司关于参加深圳农村商业银行自助渠道基金申购、定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-29 |
| 关于新增杭州联合农村商业银行股份有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-07-30 |
| 关于新增开源证券有限责任公司销售国泰基金旗下部分产品并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-08-14 |
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-08-28 |
| 关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加北京万银财富申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-08-29 |
| 关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加浙江金观诚财富管理有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-09-10 |

| | | |
|--|-------------------------------|------------|
| 关于新增浙江金观诚财富管理有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-09-10 |
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-09-11 |
| 国泰基金管理有限公司副总经理离任公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2013-09-18 |

二十三、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- (一) 中国证监会核准国泰成长优选股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《国泰成长优选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

国泰基金管理有限公司

二〇一三年十一月二日