

# 国泰金鹏蓝筹价值混合型 证券投资基金更新招募说明书 (2007 年第一号)

**基金管理人：国泰基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

## 【重要提示】

本基金根据 2006 年 8 月 17 日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]159 号核准募集。基金合同生效日为 2006 年 9 月 29 日。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者投资于本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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 2007 年 3 月 31 日。财务数据未经审计。

## 目 录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 第一部分 绪 言.....              | 3  |
| 第二部分 释 义.....              | 3  |
| 第三部分 基金管理人.....            | 7  |
| 第四部分 基金托管人.....            | 16 |
| 第五部分 相关服务机构.....           | 23 |
| 第六部分 基金的募集.....            | 30 |
| 第七部分 基金合同的生效.....          | 30 |
| 第八部分 基金份额的申购与赎回.....       | 32 |
| 第九部分 基金的投资.....            | 40 |
| 第十部分 基金的业绩.....            | 48 |
| 第十一部分 基金的财产.....           | 49 |
| 第十二部分 基金资产的估值.....         | 50 |
| 第十三部分 基金的收益与分配.....        | 54 |
| 第十四部分 基金的费用与税收.....        | 55 |
| 第十五部分 基金的会计与审计.....        | 57 |
| 第十六部分 基金的信息披露.....         | 58 |
| 第十七部分 风险揭示.....            | 61 |
| 第十八部分 基金合同的终止与基金财产的清算..... | 62 |
| 第十九部分 基金合同内容摘要.....        | 63 |
| 第二十部分 基金托管协议的内容摘要.....     | 74 |
| 第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....    | 82 |
| 第二十二部分 其他应披露的事项.....       | 85 |
| 第二十三部分 招募说明书的存放和查阅方式.....  | 86 |
| 第二十四部分 备查文件.....           | 86 |

## 第一部分 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他相关法律法规的规定以及《国泰金鹏蓝筹价值混合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。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。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释 义

招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

|         |                                      |
|---------|--------------------------------------|
| 基金或本基金： | 指国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金；                  |
| 基金合同：   | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》及其任何有效修订和补充； |
| 招募说明书：  | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；     |
| 发售公告：   | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金份额发售公告》         |

|          |                                                                                                 |
|----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 托管协议     | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金托管协议》及其任何有效修订和补充                                                           |
| 中国证监会：   | 指中国证券监督管理委员会；                                                                                   |
| 中国银监会：   | 指中国银行业监督管理委员会；                                                                                  |
| 《基金法》：   | 指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时作出的修订；        |
| 《证券法》    | 指由中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议于 2005 年 10 月 27 日修订通过的自 2006 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券法》及不时作出的修订； |
| 元：       | 指人民币元；                                                                                          |
| 基金合同当事人： | 指受基金合同约定，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；                                            |
| 基金管理人：   | 指国泰基金管理有限公司；                                                                                    |
| 基金托管人：   | 指中国银行股份有限公司；                                                                                    |
| 注册登记业务：  | 指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；                      |
| 注册登记机构：  | 指办理本基金注册登记业务的机构。本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本基金注册登记业务的机构；                           |
| 投资者：     | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；                                              |
| 个人投资者：   | 指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投                                                                      |

|            |                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------|
|            | 资基金的自然人；                                                               |
| 机构投资者：     | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；       |
| 合格境外机构投资者： | 指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；                           |
| 基金份额持有人大会： | 指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；                                   |
| 基金募集期：     | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；                |
| 基金合同生效日：   | 指基金募集期满，基金募集情况符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日； |
| 存续期：       | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限；                                                    |
| 工作日：       | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；                                                |
| 认购：        | 指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；                                   |
| 申购：        | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；                                      |
| 赎回：        | 指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；                                  |
| 转换：        | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的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另一只基金的基金份额的行为；    |

|         |                                                          |
|---------|----------------------------------------------------------|
| 转托管：    | 指基金份额持有人将其所持有的某一基金的基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为； |
| 投资指令：   | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；               |
| 代销机构：   | 指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；                     |
| 销售机构：   | 指基金管理人及本基金代销机构；                                          |
| 基金销售网点： | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；                                 |
| 指定媒体：   | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；                              |
| 基金账户：   | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；    |
| 交易账户：   | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户；            |
| 开放日：    | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；                                   |
| T 日：    | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；                               |
| T+n 日：  | 指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；                          |
| 基金收益：   | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；                  |
| 基金资产总值： | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；         |
| 基金资产净值： | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；                                       |
| 基金份额净值  | 指基金资产净值除以基金份额余额所得的基金单位份额的价                               |

值；

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

法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

## 第三部分 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

成立日期：1998年3月5日

注册地址：上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

办公地址：上海市黄浦区延安东路700号港泰广场22-23楼

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1亿元人民币

联系人：孙艳丽

联系电话：（021）33134688

基金管理人股权结构如下：

|                |     |
|----------------|-----|
| 上海国有资产经营有限公司   | 24% |
| 国泰君安证券股份有限公司   | 24% |
| 万联证券有限责任公司     | 20% |
| 上海爱建信托投资有限责任公司 | 20% |
| 中国电力财务有限公司     | 10% |
| 上海仪电控股（集团）公司   | 2%  |

## 二、基金管理人管理基金的基本情况

截止 2007 年 3 月 31 日，基金管理人共管理 4 只封闭式基金，7 只开放式基金，其中一只为系列基金（包括 2 只子基金），其基本情况如下：

| 封闭式基金    | 基金合同生效日期    | 托管银行   |
|----------|-------------|--------|
| 金泰证券投资基金 | 1998年3月27日  | 中国工商银行 |
| 金鑫证券投资基金 | 1999年10月21日 | 中国建设银行 |
| 金盛证券投资基金 | 2000年4月26日  | 中国建设银行 |
| 金鼎证券投资基金 | 2000年5月16日  | 中国建设银行 |

| 开放式基金                                                | 基金合同生效日期   | 托管银行     |
|------------------------------------------------------|------------|----------|
| 国泰金鹰增长证券投资基金                                         | 2002年5月8日  | 交通银行     |
| 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和国泰金龙债券证券投资基金） | 2003年12月5日 | 上海浦东发展银行 |
| 国泰金马稳健回报证券投资基金                                       | 2004年6月18日 | 中国建设银行   |



|                   |             |        |
|-------------------|-------------|--------|
| 国泰金象保本增值混合证券投资基金  | 2004年11月10日 | 中国银行   |
| 国泰货币市场证券投资基金      | 2005年6月21日  | 中国农业银行 |
| 国泰金鹿保本增值混合证券投资基金  | 2006年4月28日  | 中国银行   |
| 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金 | 2006年9月29日  | 中国银行   |

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会：

陈勇胜，董事长，硕士，15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公司总经理，1999年10月起任董事长。

李春平，董事、总经理，硕士、EMBA，14年证券从业经历。1993年起历任国泰证券公司行政管理部经理、延平路证券营业部总经理，1999年任国泰君安证券股份有限公司总裁助理，1999年10月起任国泰基金管理公司总经理。

袁平，董事，硕士。1989年起先后在中国银行上海分行、上海国资财务有限公司、万宝集团、上海波尔强国际贸易有限公司、富景国际贸易上海有限公司、上海国有资产经营有限公司工作，2002年1月起至今担任上海国有资产经营有限公司资产经营部总经理。

何伟，董事，硕士，14年证券从业经历。1993年至1999年担任君安证券有限公司总裁助理、总裁办主任、资产管理公司常务副总经理、北京总部总经理、北京、上海、黑龙江营业部总经理、投资二部经理等职。1999年起担任国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兼企业融资总部总监、收购兼并总部总经理、深圳分公司总经理等职。现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

王耀南，董事，大专，14年证券从业经历。1993年-1996年任职广州珠江信托投资公司证券部。1996年-2001年任职广州珠江实业集团财务公司。2001年至今在万联证券有限责任公司，先后任办公室主任、工会主席、行政总监等职。

张和之，董事，硕士。曾任北京半导体器件二厂财务科会计主管、审计科干部，水利电力部机关财务处主任科员，能源部机关财务处副处长，电力部机关事务局经营财务处处长，国电中兴实业发展总公司总会计师，现任中国电力财务有限公司副总经理。

张明芝，董事，本科。1994年起在上海商业网点股份公司从事投资计划和资产管理的工作，1998年历任上海爱建信托投资公司投资基金部副经理、资产信托总部总经理。

龚造成，独立董事，硕士。长期从事金融证券研究和管理，1979 起历任上海财经学院副教授、教授、副院长，1984 年起历任人行上海分行副行长、行长，上海外管局副局长、局长，1992 年起任上证所常务理事，1995 年起任上海证券期货学院院长。

曹尔阶，独立董事，本科。长期从事金融证券研究和管理，中国国际金融有限公司高级顾问，中国财科所教授，清华大学、中央财大、中国金融学院兼职教授，曾任中国投资咨询公司总经理。

吴鹏，独立董事，博士。著名律师，执业范围包括金融证券，北京中伦金通律师事务所合伙人、主任，北京大学客座教授，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。

## 2、监事会：

黄明达，监事，博士。曾任华东师范大学城市与区域发展研究中心讲师，深圳龙藩实业股份有限公司研究发展部副总经理，上海国有资产经营有限公司资金管理部副总经理，现任上海国有资产经营有限公司资金管理部总经理。

李芝樑，监事，硕士。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事，中国电力财务有限公司债券基金部副经理，现任中国电力财务有限公司债券基金部经理。

黄永明，监事，硕士，12 年证券从业经历。1995 年起任国泰证券公司行政管理部经理，1998 年起历任国泰基金管理有限公司综合部、监察部、战略管理部副总监。

## 3、其他高级管理人员：

陈坚，副总经理，MBA，证券从业年限 13 年。1994 年起历任国泰证券公司研发部副总经理、总经理，1998 年起任国泰基金管理有限公司副总经理。

陈甦，副总经理，金融学博士后，9 年证券从业经历。曾在中国人保信托投资公司投资研究中心任研究员、中国人寿保险公司资金运用中心组合管理处副处长。2003 年 3 月起在国泰基金管理有限公司任职，历任投资总监、副总经理职务。

丁昌海，督察长，硕士，14 年证券从业经历。1994 年起历任国泰证券公司证券发行部副经理，证券投资二部和基金管理部经理，1998 年起历任国泰基金管理有限公司研究开发部总监，稽核监察部总监，公司督察长。

## 4、本基金基金经理及相关研究人员配备

### （1）现任基金经理

黄刚，男，经济学硕士，14 年证券期货从业经历。曾就职于上海金属交易所、上海期货交易所。2000 年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部经理、市场部经理、金鹰增长基金基金经理、社保基金的基金经理，2007 年 4 月起担任国泰金鹏蓝筹基金的基金经理。

### （2）历任基金经理

2006年9月-2007年3月由冯天戈担任基金经理，2007年4月起由黄刚担任基金经理。

### (3) 相关研究人员配备

为确保实现基金合同规定的投资目标，本基金专门配备了精通基本面研究和数量分析的研究人员协助基金经理的投资管理工作。研究开发部在对宏观经济发展态势、利率走势和行业个股分析的基础上拟定投资建议；金融工程部负责数量分析，根据历史模拟和风险测算的结果提出投资可行性分析。

## 5、投资决策委员会

本基金管理人设有投资决策委员会，由公司总经理、分管投资副总经理以及研究开发部、固定收益部、基金管理部负责人等人员组成，督察长列席公司投资决策委员会会议。其主要职责是根据有关法规、基金合同以及公司研究部门和基金小组提供的研究报告和投资计划，确定基金资产投资策略，审批基金投资计划。

投资决策委员会成员组成如下：

李春平（总经理）、陈甦（副总经理兼投资总监）、周传根（研究开发部总监）、何江旭（基金管理部总监）、崔海峰（基金管理部副总监、首席基金经理）、高红兵（固定收益部总监）。

上述成员之间均不存在近亲属关系。

## 四、基金管理人的职责

- （一） 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；
- （二） 办理基金备案手续；
- （三） 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；
- （四） 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；
- （五） 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- （六） 编制季度、半年度和年度基金报告；
- （七） 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- （八） 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- （九） 召集基金份额持有人大会；
- （十） 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；

- (十一) 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；
- (十二) 有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

## 五、基金管理人的承诺

- (一) 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；
- (二) 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风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - 1. 基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - 2. 不公平地对待管理的不同基金财产；
  - 3. 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - 4. 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - 5. 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
- (三) 基金管理人承诺严格遵守基金合同，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；
- (四) 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；
- (五) 基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

## 六、基金经理的承诺

- (一) 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；
- (二) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (三) 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；
- (四) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

## （一）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可操作性。

### 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。

## （二）基金管理人内部控制制度五要素

### 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3名。董事会下设资格审查委员会、合规审核委员会、薪酬考核委员会等5个专业委员会，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者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帐、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：

- 1) 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；
- 2) 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；
- 3) 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；
- 4) 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；
- 5) 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；
- 6) 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《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。

#### （三）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。

## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”），基本情况如下：

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门总经理：秦立儒



托管部门联系人：宁敏

电话：（010）66594977

传真：（010）66594942

发展概况：

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域，并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务，截至 2006 年底，在世界 27 个国家和地区拥有分支机构，与 1500 家国外代理行及 47000 家分支机构保持了代理业务关系，凭借全球化的网络及其优质的服务、雄厚的实力，本行在国内市场保持着独特的竞争优势。

在近百年的岁月里，中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖，打造了卓越的品牌，与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务，包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括贷款、票据贴现、贸易融资、存款、结算、清算、现金管理等各项金融产品和度身定制的财务综合解决方案。中国银行为个人客户提供一系列个人或家庭银行产品及服务，包括储蓄存款、消费信贷、支付结算、银行卡和财富管理等。在多年的发展历程中，中国银行曾创造了中国银行业的许多第一，所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河，在业界独领风骚，享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域居于领先地位，且保持了持续快速增长。截至 2006 年底，中国银行境内外分支机构共有 11,241 家，其中境内拥有 37 家一级分行、直属分行，283 家二级分行及 10277 家分支机构，境外分支机构 643 家分行、子公司及代表处，是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念，不断向国际化一流大银行的目标迈进。

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史，在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立，至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间，中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代，中国银行作为民族金融的支柱，以服务大众、振兴民族金融业为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。

新中国成立后，中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行，继续保持和发扬了顽强创业的企业精神，为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994 年随着金融体制改革的深化，中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化，与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年，中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势，中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年，中国银行成功重组了香港中银集团，将 10 家成员银行合并成当地注册的“中国银行（香港）有限公司”。2002 年 7 月，重组

后的中国银行（香港）有限公司在香港联交所成功上市，成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004年7月14日，中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，脱颖而出，作为我国银行业的优秀代表携手北京2008年奥运会，成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于2003年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行，围绕“资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行”的目标，进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制，稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004年8月26日，中国银行股份有限公司成立，中国银行成为国家控股的股份制商业银行，标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步，中国银行的历史翻开了新的一页。

2006年6月1日，中国银行在香港联交所成功挂牌上市，共集资754.27亿港元。继成功发行H股并上市之后，2006年7月5日，中国银行在上海证券交易所成功发行A股，是中国资本市场第一家国有商业银行股，是全流通背景下的第一家“海归”股。在国际和国内资本市场同时上市，进一步提高了资本实力，中国银行进入了一个新的发展时期。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中，在“新兴+转轨”的中国资本市场改革的大趋势中，中国银行将健康、快速、持续发展，创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章！

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从1990年以来，中国银行一直荣登《财富》500强排行榜，并被《财富》（中文版）评选为2006年最受赞赏的中国公司；自1992年，中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为“中国最佳银行”或“中国最佳本地银行”，并于2005年被《欧洲货币》评为中国及香港“最佳商业银行”（2005年房地产奖项）；2004至2006年，中国银行连续三年被《环球金融》杂志评为“中国最佳贸易融资银行”和“中国最佳外汇银行”；在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的“2005中国营销盛典”中，被评为“2005年度中国企业营销创新奖”（是获奖企业中唯一的金融企业）；根据英国《金融时报》2005年8月进行的调查，中国银行是中国的十大国际品牌之一；另外，中国银行被国家工商总局授予“中国驰名商标”。2006年在《银行家》杂志“世界1000家大银行”中排名第17位，被《财资》杂志评为2006年度AAA奖项中国地区最佳现金管理银行、中国地区最佳贸易融资银行，同时《亚洲货币》杂志也将中国银行评为“中国最佳现金管理银行”；被《新兴市场》杂志评为“2006年亚洲地区年度最佳银行”，被《亚洲风险》杂志评为“2006年度中国最佳银行”；获得了《亚洲法律事务》杂志2006年“银行和财经服务公司法务组大奖”，是国内唯一获得该奖项的金融机构；被《投资者关系》杂志评选为“中国市场企业交易最佳投资者关系”、“香港市场IPO最佳投资者关系”；在第十四届中国国际金融（银行）技术暨设备展览会上，本行的产品获得“金融业务创新奖”；此外，积极推进企

业文化建设，营造诚信、绩效、责任、创新、和谐的氛围，于 2005 年，被《中国人才》（《China Staff》）授予“中国大陆‘最佳人力资源战略奖’”，这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖；2006 年再次荣获“优信咨询（Universum）”评选的“大学生心目中最理想雇主奖”。

世纪信誉，环球共享。中国银行将秉承“以客户为中心，以市场为导向，强化公司治理，追求卓越效益，创建国际一流大银行”的宗旨，依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验，竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务，与广大客户携手共创美好未来。

#### 财务概况：

2006 年，中国银行资产总额 53252.73 亿元人民币，股东权益（不含少数股东权益）合计 3882.54 亿元人民币，分别比上年增长 12.28%和 66.03%，实现净利润 418.92 亿元人民币，比上年增长 52.38%，总资产回报率和权益净回报率分别达到 0.94%和 13.86%，同比提高 0.22 个百分点和 0.70 个百分点；资产质量持续改善，2006 年末不良贷款比率从 2005 年末的 4.62%进一步下降到 4.04%，下降 0.58 个百分点，资本充足率为 13.59%，核心资本充足率为 11.44%，分别较上年增加 3.17 个百分点及 3.36 个百分点。

#### （二）主要人员情况

肖钢先生，自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月，1981 年毕业于湖南财经学院，1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月，1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司执行董事、副行长。自 2000 年 11 月起任中国银行副行长。1993 年 12 月至 2000 年 11 月任中国人民建设银行副行长，1987 年 12 月至 1993 年 12 月历任中国人民建设银行大连市分行行长、中国人民建设银行计算机中心主任、国际业务部总经理。李先生出生于 1955 年 4 月，1978 年毕业于南京气象学院。

秦立儒先生，自 2005 年 10 月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005 年 5 月至 2005 年 10 月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004 年 4 月至 2005 年 5 月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002 年 7 月至 2004 年 4 月任中国银行（香港）有限公司资金部总经理；1999 年 6 月至 2002 年 7 月任香港中银集团外汇交易中心总经理；1997 年 9 月至 1999 年 6 月任广东省银行香港分行（香港中银集团）总经理；1995 年 11 月至 1997 年 9 月任中国银行总行资金部副总经理，主管全球资金交易；1991 年 5 月至 1995 年 11 月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理；1987 年 10 月至 1991 年 5 月历任中国银行总行资金部副处长、处长；1982 年 8 月至 1987 年 9 月任中国银行卢森堡分行外汇部经理；1978 年 2 月至 1982 年 7 月，先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于 1955 年 5 月，1978 年毕业于北京外贸学院。

### （三）证券投资基金托管情况

截止到 2007 年 3 月末，中国银行已托管景宏、同盛、兴安、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币市场、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、万家 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理 2020、泰达荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合基金等 49 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队；并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 90 余人，其中硕士学历以上人员 21 人，具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

### （五）基金托管人的内部控制制度

## 1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系，以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是：以完善的内部控制组织体系为保障，以体现制衡原则、健全有效的制度为基础，以精细化的过程为着眼点，以激励约束机制和问责制为引导，以信息科技手段为依托，大力培育合规文化，努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标，中国银行从明确职责入手，完善内部控制组织体系建设；从制度建设入手，夯实内部控制基础；从细节入手，实现精细化的过程控制；从完善激励约束机制和问责制入手，引导内部控制目标的实现；从加强信息技术手段入手，提高内部控制水平和质量；从加强教育培训入手，促进合规文化的形成。

## 2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 8 月 26 日成立以来，按照国家有关法律法规制定了新的公司章程，形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1) 董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会，并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施，以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构，风险管理部拟订风险管理策略及工作计划，并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能，中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动，对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估，负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005 年 11 月，董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程，进一步明确内部稽核职能独立于业务部门，并由董事会的稽核委员会领导，在董事会授权下，稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算，以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门，各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核，向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制，明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任，相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2) 中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任，管理本行风险的各个方面，包括风险管理策略、措施和信贷政策，并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行，决定内部控制基本制度，评估内部控制体系的有效性，以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷，督导改进措施的落实，审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划，制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度，并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构，该部负责管理法律风险、合规风险，并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理，以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策，制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构，该部按照资产负债管理委员会制订的政策，管理本行流动性，预测本行流动性的需求和风险，并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策，负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜，法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3) 托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组，作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

### 3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

### 4、其他事项

最近一年内，基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

### (六) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）直销机构

##### 1. 国泰基金管理有限公司上海理财中心

地址：上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼

电话：（021）23060330

传真：（021）23060372

客户服务专线：4008-888-688，（021）33134688

联系人：孙艳丽、陆未定

网址：www.gtfund.com

##### 2. 国泰基金管理有限公司北京理财中心

地址：北京市海淀区中关村南大街 1 号友谊宾馆贵宾楼一层

负责人：吴畏

电话：（010）68498575

传真：（010）68498182

联系人：隋素梅

##### 3. 国泰基金电子交易平台

网站: [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 登录网上交易页面

电话: (021) 23060367

联系人: 严仁明

## (二) 代销机构

### 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: 肖钢

客户服务电话: 95566

传真: (010) 66594946

### 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

法定代表人: 郭树清

客服电话: 95533

### 3. 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区商城路618号

法定代表人: 祝幼一

联系电话: (021) 62580818-213

传真: (021) 52610172

联系人: 芮敏祺

### 4. 中信建投证券有限责任公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人: 黎晓宏

联系电话: (010) 65183888

传真: (010) 65182261

联系人: 徐翼

### 5. 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



联系电话：（021）53594566—4125

传真：(021)53858549

联系人：金芸

6. 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：朱利

联系电话：（010）66568587

传真：(010)66568536

联系人：郭京华

7. 金通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市凤起路108号国信房产大厦9-12层

法定代表人：应土歌

联系电话：（0571）85783743

传真：（0571）85783771

联系人：余少南

8. 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：丁国容

联系电话：（021）54033888

传真：（021）54038844

联系人：胡洁静

9. 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

联系电话：（0755）82943141

传真：（0755）82943121

联系人：曾兴华

10. 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道720号20楼

法定代表人：王益民

联系电话：（021）62476600\*3019

传真：（021）62474651

联系人：盛 云

11. 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市石路爱河桥路28号

法定代表人：吴永敏

联系电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

联系人：方晓丹

12. 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系电话：(021)68419974

传真：(021)68419867

联系人：杨盛芳

13. 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、41和42楼

法定代表人：王志伟

电话：（020）87555888

传真：（020）87557985

联系人：肖中梅

14. 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路111号

法定代表人：蒋元真

电话：021—665081063

传真：021—65081434

联系人：刘永

客户服务电话：021-962518

15. 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建设路2号宏源大厦

法定代表人：汤士生

联系电话：010-62267799转6316

传真：010-62294470

联系人：刘元平

16. 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室

法定代表人：岳献春

联系电话：010-85252605

传真：010-85252655

联系人：杨魁华

17. 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：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人：管荣升

电话：（0791）6289771

传真：（0791）6289395

联系人：万齐志

18. 中信证券有限责任公司

注册地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

19. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼

法定代表人：王明权

电话：（021）68816000

传真：（021）68815009

联系人：刘晨

20. 渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号

办公地址：天津市河西区宾水道3号

法定代表人：张志军

电话：（022）28451883

传真：（022）28451616

联系人：徐焕强

21. 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市东风东路836号东峻广场3座5、34、35楼

法定代表人：李舫金

联系电话：020-87691111

传真：020-87691530

联系人：何勇峰

22. 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

23. 华泰证券证券有限责任公司

注册地址：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

联系电话：025-84457777-721

联系人：袁红彬

24. 长江证券证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华路特8号

法定代表人：胡运钊

联系电话：021-63296362

传真：021-51062920

联系人：甘露

25. 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路316号

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

26、国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

联系电话：（0771）5539262

传真：（0771）5539033

联系人：覃清芳

27、北京银行股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 17 号

法定代表人：阎冰竹

联系人：李娟

电话：010-66226044 / 010-66223251

传真：010-66226045 / 010-66226047

客户服务热线：010-96169

## 二、 注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

办公地址：上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼

法定代表人：陈勇胜

传真：（021）23060266

联系人：孙艳丽、陆未定

客户服务专线：4008-888-688，（021）33134688

## 三、 出具法律意见书的律师事务所

律师事务所：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：吕红

经办律师：廖海、吕红

#### 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有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：汪棣、陈宇

## 第六部分 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基金字[2006]159号文批准，于2006年8月28日起向全社会公开募集。截止2006年9月27日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的净销售总额为1,248,741,994.07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232,118.68元人民币。上述资金已于2006年9月29日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管专户。

### 二、 基金类型

混合型

### 三、 基金运作方式

契约型、开放式

### 四、 基金的存续期间

不定期

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、 基金备案的条件

（一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

1. 基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
2. 基金份额持有人的人数不少于 200 人。

## （二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

## （三）基金合同的生效

本基金经中国证监会证监基金字[2006]159 号文件批准设立，于 2006 年 8 月 28 日起向全社会公开募集。截止 2006 年 9 月 27 日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的净销售总额为 1,248,741,994.07 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 232,118.68 元人民币。上述资金已于 2006 年 9 月 29 日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 24138 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 1,248,974,112.75 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次基金募集期间所发生的律师费和会计师费等费用从基金募集费用中列支，不另从基金资产支付；与本基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

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》以及《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金招募说明书》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2006 年 9 月 29 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

## （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金基金合同生效后的存续期间，连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会，说明出现上述情况的原因及解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或通过国泰基金电子交易平台（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### （一） 开放日

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。

国泰电子交易平台提供 7\*24 小时服务，接受个人投资者申购、赎回与转换的申请，但交易日下午 15:00 以后接受的交易申请顺延至下一交易日处理。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

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

#### （二） 申购、赎回的开始日及业务办理时间

本基金已于 2006 年 11 月 13 日起开始办理日常申购交易业务，2006 年 11 月 27 日起开始办理日常赎回交易业务。

### 三、申购与赎回的原则

（一）“未知价”原则，即申购、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；

（二）“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；

（三）基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

（四）当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。



基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但最迟应在新的原则实施 3 个工作日前予以公告。

#### 四、 申购与赎回的数额限定

##### （一） 申购金额的限制

代销机构每个账户单笔申购的最低金额为 1000 元（含申购费）；直销机构每个账户首次申购本基金的最低金额为 1 万元（含申购费），已在直销机构有本基金认购记录的投资者的首次申购最低金额的限制，追加申购本基金的最低金额为 1000 元（含申购费）。

##### （二） 赎回份额的限制

基金份额持有人在销售机构办理赎回时，每次赎回申请不得低于 500 份基金份额，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额不足 500 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

（三） 基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整，必须提前三个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告。

#### 五、 申购和赎回的程序

##### （一） 申购和赎回的申请方式

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

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### （二） 申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

##### （三） 申购和赎回的款项支付

申购采用全额付款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投

资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

## 六、 申购和赎回的数额与价格

### （一） 申购份额、余额的处理方式

1. 申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2. 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回净额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

### （二） 申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 申购金额 × 基金申购费率

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

### （三） 赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回金额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 基金赎回费率

赎回净额 = 赎回金额 - 赎回费用

### （四） 基金份额净值的计算公式

基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数

基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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。

## 七、基金的申购费与赎回费

### （一）申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。若投资者在一天之内有多笔申购，则按每次申购金额对应费率分别收取申购费。申购费用由基金申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的申购费率如下：

| 申购金额（含申购费）       | 申购费率     |
|------------------|----------|
| 50 万元以下          | 1.5%.    |
| 50 万元（含）－ 200 万元 | 1.0%     |
| 200 万元（含）－500 万元 | 0.6%     |
| 500 万元（含）以上      | 1000 元/笔 |

举例说明：

某投资者以60万元申购本基金，申购费率为1.0%，假设申购当日基金份额净值为1.10元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 600,000 \times 1.0\% = 6,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购净额} = 600,000 - 6,000 = 594,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 594,000 / 1.10 = 540,000.00$$

即投资者以 60 万元申购本基金，如果申购当日基金份额净值为 1.10 元，则其可得到的申购份额为 540,000.00 份。

### （二）赎回费用

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

本基金的赎回费率如下：

| 持有时间 | 赎回费率 |
|------|------|
|------|------|

|          |      |
|----------|------|
| 1年以下     | 0.5% |
| 1年（含）—2年 | 0.2% |
| 2年（含）以上  | 0    |

（注：1年按365天计算）

举例说明：

某基金份额持有人赎回持有不超过1年的1000份基金份额，赎回对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.10元，则其可得到的赎回净额为：

赎回金额 =  $1000 \times 1.10 = 1100$  元

赎回费用 =  $1100 \times 0.5\% = 5.50$  元

赎回净额 =  $1100 - 5.50 = 1094.50$  元

即基金份额持有人赎回持有不超过1年的1000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.10元，则其可得到的赎回净额为1094.50元。

（三） 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前3个工作日中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（四） 针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

（五） 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，对投资者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，基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 八、 暂停申购的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （一） 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- （二） 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （三） 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

- （四）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- （五）当基金管理人认为某笔申购申请会影响到其他基金份额持有人的利益时，可以拒绝该笔申购申请；
- （六）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

## 九、 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- （一）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- （二）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （三）基金发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- （四）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （五）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

## 十、 巨额赎回的情形及处理方式

### （一）巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

### （二）巨额赎回的处理方式

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

1. 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2. 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

3. 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

4. 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过二十个工作日，并应当在中国证监会指定媒体公告。

## 十一、重新开放申购或赎回的公告

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

- （一） 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人将于重新开放日，在中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。
- （二） 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日，在中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。
- （三） 如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告 1 次；当连续暂停时间超过 2 个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日，在中国证监会指定报刊或其他相关媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

## 十二、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。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。

### 十三、 转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金份额转入手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管转入手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照业务规则的有关规定以及代销机构的相关开放式基金业务规则。

### 十四、 基金的非交易过户

（一） 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行等三种情形。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是符合本基金合同规定的投资者。其中：

1、“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

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

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

（二） 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料，其中，因继承、捐赠原因导致的非交易过户向基金销售网点申请办理，因强制执行原因导致的非交易过户直接向基金注册登记机构统一申请办理。

（三） 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

### 十五、 基金的冻结与质押

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

根据相关法律法规的规定或有关监管机构的认可，基金管理人可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 第九部分 基金的投资

### （一）投资目标

本基金将坚持并深化价值投资理念。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增值，力争获取更高的超额市场收益。

### （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、债券、现金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0-60%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### （三）投资理念

价格终将反映价值。

### （四）投资策略

#### 1. 大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足各类基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同，预测短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。



在定量分析方面，主要采用均衡市盈率预测模型，并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平，然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较，来判定股票市场系统性风险的高低，最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外，本基金还参照股息率、收益率差距表（1/PE-银行利率）等指标，来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面，主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

## 2. 股票资产投资策略

本基金的股票资产投资采取核心-卫星投资策略(Core-Satellite strategy)，核心投资主要以新华富时蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为标的，构建核心股票投资组合，以期获得市场的平均收益（benchmark performance），这部分投资至少占基金股票资产的 80%；同时，把握行业周期轮动、市场时机等机会，通过自下而上、精选个股、积极主动的卫星投资策略，力争获得更高的超额市场收益(outperformance)。

### （1）核心股票资产投资策略

本基金的核心股票投资策略主要以新华富时蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为选股池，采取增强型的指数跟踪技术。即以抽样复制的形式，在核心股票选股池中选取一定数量的个股进行投资，使核心股票的投资表现和新华富时蓝筹价值 100 指数的表现在一定范围内联动，即核心股票收益率基本跟踪新华富时蓝筹价值 100 指数的收益率。

### （2）卫星股票资产投资策略

本基金的卫星股票投资策略将充分发挥基金经理人在主动投资上具有的优势，着眼于企业的未来盈利水平，选取预期成长性强，并能将成长转换成实实在在收益的个股，与核心股票组合形成互补，卫星股票组合对于整个基金的股票组合来说能起到增加超额收益、降低组合风险的作用。本基金通过成长因子来筛选成长性股票，成长因子主要包括以下指标：

- 1) 总资产增长率
- 2) 主营业务增长率
- 3) 净利润增长率
- 4) 资产回报增长率

以上四个指标按一定的权数加权平均，形成一个复合型的成长因子，能够更为全面地判断企业的成长性。

### 3. 债券资产投资策略

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，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

(1) 以对长期利率预期为基础确定期限结构。在预期利率下降时，增加组合久期，提高债券价格上升产生的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，降低债券价格下降产生的损失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移，降低债券组合的整体持仓比例，同时降低组合久期，来使组合损失降到最低。

(2) 以收益率曲线分析为基础确定收益率曲线配置。根据收益率曲线可能发生变动的种类，如平坦化、陡峭化、正向蝴蝶型、反向蝴蝶型等，通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例，以期从短、中、长期债券的相对价格差中取得收益。

(3) 以相对利差分析为基础确定类属配置。通过对各类属债券历史利差的数量化分析，寻找市场投资机会。比如在预期国债与金融债利差缩小时，卖出国债，买入金融债。

(4) 以流动性分析和收益率分析为基础确定市场配置。交易所国债市场发行总量较小，大额交易流动性较差、小额交易流动性较好，而银行间国债市场发行总量较大，大额交易成本低，某些时段流动性较好。故根据不同时段对流动性的不同需求，在两个市场间配置债券资产。

在通过上述配置方法构建债券组合之后，本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整：

(1) 短期经济运行指标，如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动，引起的市场实际利率的变动；

(2) 中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动，导致整个投资组合重新估价；

(3) 央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

(4) 债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与认购情况发生变化，导致二级市场收益率产生波动；

(5) 由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

(6) 市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

(7) 单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

#### (五) 选券标准

##### 1. 债券资产选择标准

(1) 个券信用等级在 AA 级或者相当于 AA 级的信用评级及以上；

- (2) 相同剩余期限中到期收益率较高的；
- (3) 有较好流动性（日成交量大、买卖价差小）；
- (4) 通过二叉树模型估算所含期权被市场低估的可转债；
- (5) 可转债具有不可撤销的连带责任担保或者资产抵押。

## 2. 股票资产选择标准

### (1) 核心股票组合的选择

- 1) 以新华富时蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为初始集合；
- 2) 以企业的财务报表为基础预测成份股个股未来现金流；
- 3) 以企业的平均资金成本（WACC）为折现因子将成份股个股的未来现金流折现（DCF）；将个股的净现值（NPV）和市值比较，按行业分类，选取价值被低估的个股。

### (2) 卫星股票组合的选择

- 1) 以核心股票选股范围（新华富时蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股）以外的股票为初始集合；
- 2) 选取成长因子，计算个股的成长性；
- 3) 按行业对个股的成长值进行数据标准化；
- 4) 按标准化的成长值对个股排序，选取成长值排名靠前的个股。

## 3. 权证选择标准

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

(1) 考量标的股票合理价值、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 and 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。

## (六) 投资决策过程

### 1. 投资依据

- (1) 有关法律、法规、基金合同和基准指数等的相关规定；
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。

### 2. 投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关基准指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

### 3. 投资程序

(1) 金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标, 结合公司内外研究报告, 对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析, 依此提出研究分析报告。

(2) 投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告, 定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议, 决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议, 进行基金投资管理的日常决策。

(3) 基金经理以基金合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为依据建立基金的投资组合。可采取适当的技术和方法, 降低交易成本、控制投资风险。

(4) 中央交易室根据基金经理下达的交易指令制定交易策略, 完成具体证券品种的交易。

(5) 金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估, 并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

(6) 基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和监察稽核部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果, 对投资组合进行监控和调整, 密切跟踪标的指数。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序, 并予以公告。

### 4. 关于交易过程的说明

本基金管理人管理的各基金将独立、平等地使用公司统一的中央交易平台。中央交易室公平、及时地处理所有投资产品的交易指令, 并保护不同产品之间的交易秘密。基金经理小组必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定, 经由中央交易室统一下达交易指令。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库。交易对手库由银行间市场成员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级较高的交易对手组成, 并报投资决策委员会批准后实施。

交易对手库由公司债券交易员发起更新, 交易对手库的更新包括定期更新和临时更新, 定期更新为每半年一次, 债券交易员应于每半年初整理更新交易对手库清单, 并报投资决策委员会审批后交固定收益投资经理和中央交易室实施。当银行间成员资质发生重大变化时, 债券交易员应及时发起临时调整。上述调整应及时通知基金托管人。

基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督。

### (七) 业绩比较基准

业绩比较基准=60%\*新华富时蓝筹价值 100 指数+40%\*新华雷曼中国债券指数

本基金的股票业绩比较基准为新华富时蓝筹价值 100 指数，债券业绩比较基准为新华雷曼中国债券指数。

如果业绩比较基准中的指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更而导致指数不宜继续作为本基金的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的业绩比较基准，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更基准指数，无须经基金份额持有人大会决议通过，在与基金托管人协商一致并履行合适程序后，于正式实施变更前 2 日内在中国证监会指定的媒体上予以公告。

新华财通投资咨询（北京）有限公司，新华富时指数有限公司，FTSE 国际有限公司，新华财经有限公司，伦敦证券交易所和金融时报有限公司并未以任何形式发起、认可、销售和推广国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金，同时上述六方从未保证或表示（明示或暗示）使用新华富时蓝筹价值 100 指数或该指数在某日某时的数据可以得到的结果。新华富时指数由新华富时或代表新华富时编制和计算。新华富时将采取一切必要措施以确保指数的精确性。除根据有关法律法规要求或有关协议另有约定外，无论因为疏忽或其他原因，上述六方不因指数的任何错误而对任何人负责，也无义务对任何人和任何错误进行建议。

“FTSE™”是属于伦敦证券交易所和金融时报有限公司共同拥有的商标。“富时指数”是富时国际有限公司的商标。“Xinhua”和“新华”是新华财经有限公司的服务标志和商标。新华富时指数有限公司拥有对以上所有商标的授权使用许可。

新华富时蓝筹价值 100 指数由新华富时指数有限公司编制。关于指数价值和成分股名单的所有版权归属新华富时指数有限公司，基金管理人已然获得完全许可使用此版权创建产品。

#### （八）风险收益特征

本基金属于中等风险的证券投资基金品种，基金在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的超额收益。

#### （九）投资禁止行为与限制

##### 1. 禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 2. 基金投资组合比例限制

- (1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- (3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (4) 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 5%；
- (5) 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%；
- (6) 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%；
- (7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过本基金资产净值的 10%；
- (9) 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%；
- (10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过本基金资产净值的 20%；
- (11) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定对上述投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更或取消，则本基金可相应地对该项规定进行修改或取消，无须召开基金份额持有人大会。但应根据有关规定报中国证监会审查或备案。

## (十) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司改革或合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

#### （十一）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

#### （十二）基金投资组合报告

##### 1、报告期末基金资产组合情况

| 项 目        | 金 额(元)           | 占基金资产总值比例 |
|------------|------------------|-----------|
| 股票         | 3,251,324,224.95 | 89.51%    |
| 债券         | 10,387,000.00    | 0.29%     |
| 权证         | 0                | 0.00%     |
| 银行存款和清算备付金 | 291,161,333.99   | 8.02%     |
| 应收证券清算款    | 68,301,513.25    | 1.88%     |
| 其他资产       | 11,117,403.54    | 0.31%     |
| 合 计        | 3,632,291,475.73 | 100.00%   |

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行 业              | 市 值(元)           | 占净值比例  |
|------------------|------------------|--------|
| A 农、林、牧、渔业       | -                | -      |
| B 采掘业            | 182,417,823.36   | 5.15%  |
| C 制造业            | 1,270,238,173.44 | 35.87% |
| C0 食品、饮料         | 183,903,246.09   | 5.19%  |
| C1 纺织、服装、皮毛      | 40,533,064.60    | 1.14%  |
| C3 造纸、印刷         | 15,130,000.00    | 0.43%  |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 197,518,746.19   | 5.58%  |
| C5 电子            | 37,446,757.44    | 1.06%  |
| C6 金属、非金属        | 332,750,249.18   | 9.40%  |
| C7 机械、设备、仪表      | 426,370,225.37   | 12.04% |
| C8 医药、生物制品       | 21,186,885.57    | 0.60%  |
| C99 其他制造业        | 15,398,999.00    | 0.43%  |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 118,370,268.50   | 3.34%  |
| E 建筑业            | 21,708,780.90    | 0.61%  |
| F 交通运输、仓储业       | 319,003,445.28   | 9.01%  |
| G 信息技术业          | 313,727,175.35   | 8.86%  |
| H 批发和零售贸易        | 112,588,280.00   | 3.18%  |
| I 金融、保险业         | 655,844,936.56   | 18.52% |
| J 房地产业           | 162,828,265.69   | 4.60%  |
| K 社会服务业          | -                | -      |
| L 传播与文化产业        | 65,077,075.87    | 1.84%  |
| M 综合类            | 29,520,000.00    | 0.83%  |
| 合 计              | 3,251,324,224.95 | 91.82% |

##### 3、报告期末按市值占基金资产净值比例的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 市值(元)          | 占净值比例 |
|----|--------|------|------------|----------------|-------|
| 1  | 600030 | 中信证券 | 5,205,680  | 224,000,410.40 | 6.33% |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 9,550,000  | 165,979,000.00 | 4.69% |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 5,449,965  | 145,623,064.80 | 4.11% |
| 4  | 000063 | 中兴通讯 | 3,238,545  | 142,172,125.50 | 4.02% |
| 5  | 000800 | 一汽轿车 | 14,899,887 | 134,694,978.48 | 3.80% |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 11,009,920 | 109,328,505.60 | 3.09% |
| 7  | 000002 | 万科A  | 6,509,479  | 107,992,256.61 | 3.05% |
| 8  | 601006 | 大秦铁路 | 8,163,488  | 104,900,820.80 | 2.96% |
| 9  | 600019 | 宝钢股份 | 10,098,900 | 99,979,110.00  | 2.82% |
| 10 | 600096 | 云天化  | 4,588,980  | 91,596,040.80  | 2.59% |

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元)         | 占净值比例 |
|----|------|---------------|-------|
| 1  | 企业债券 | 10,387,000.00 | 0.29% |
|    | 合 计  | 10,387,000.00 | 0.29% |

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

| 序号 | 债券名称   | 市值(元)         | 占净值比例 |
|----|--------|---------------|-------|
| 1  | 07 武钢债 | 10,387,000.00 | 0.29% |

6、投资组合报告附注

- (1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、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) 其他资产的构成如下：

| 分 类   | 市值(元)         |
|-------|---------------|
| 交易保证金 | 1,068,754.70  |
| 应收利息  | 92,486.24     |
| 应收申购款 | 9,956,162.60  |
| 合 计   | 11,117,403.54 |

- (4) 报告期末基金未持有可转换债券。
- (5) 本报告期内，未投资权证。
- (6) 本报告期内，未投资资产支持证券。

## 第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2007 年 3 月 31 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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   |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2006年9月29日至2007年3月31日 | 50.83% | 1.66%     | 53.17%     | 1.29%         | -2.34% | 0.37% |

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- （一） 银行存款及其应计利息；
- （二） 清算备付金及其应计利息；
- （三） 根据有关规定缴纳的保证金；
- （四） 应收证券交易清算款；
- （五） 应收申购款；
- （六） 股票投资及其估值调整；
- （七） 债券投资及其估值调整和应计利息；
- （八） 其他投资及其估值调整；
- （九） 其他资产等。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

- （一） 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

- （二）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。
- （三）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。
- （四）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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。
- （五）基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。
- （六）除法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值日

基金合同生效后，每个开放日对基金财产进行估值。

### 二、估值目的

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

### 三、估值方法

#### （一）股票估值方法

1. 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。
2. 未上市股票的估值：
  - 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；
  - 首次发行的股票，按成本价估值。
3. 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

## （二）债券估值方法

1. 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。
2. 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值。
3. 未上市债券按其成本价估值；
4. 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值；
5. 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1—4 小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1—4 小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；
6. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## （三）权证估值方法

1. 从确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；在任何情况下，基金管理人如采用本方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

2. 从确认日起到卖出日或行权日止，未上市交易的权证投资按公允价值估值；
3. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## （四）资产支持证券估值方法

基金投资于资产支持证券应当按照公允原则进行估值。

#### 四、 估值对象

基金所持有的股票、债券和银行存款本息、应收款项和权证等其他投资等资产。

#### 五、 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，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。

#### 六、 基金份额净值的确认及错误的处理方式

基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

##### （一）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资者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。

由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此

造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## （二）差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错：

1. 基金管理人对估值差错承担责任。如基金管理人的估值结果与基金托管人复核结果不一致，且基金托管人的估值数据正确，则基金托管人对此估值差错不承担责任；若基金托管人的估值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任；
2. 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，给当事人造成的损失由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；
3. 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；
4. 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；
5. 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；
6. 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；
7. 按法律法规规定的其他原则处理差错。

## （三）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

1. 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；
2. 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
3. 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
4. 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
5. 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

因基金份额净值计算错误给投资人造成损失的处理原则、方式适用基金管理人根据相关法律法规及基金合同制订的业务规则中的相关规定；基金管理人和基金托管人之间的责任分担按照相互间签订的《托管协议》的相关约定。

## 七、 暂停估值的情形

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

## 八、 特殊情形的处理

基金管理人按估值方法的第（一）项中的第 4 项条款、第（二）项中的第 5 项条款、第（三）项中的第 1 项条款、第（四）项等进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

# 第十三部分 基金的收益与分配

## 一、基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## 二、基金收益分配原则

- （一） 基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- （二） 每一基金份额享有同等分配权；
- （三） 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- （四） 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；
- （五） 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- （六） 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次，至多 6 次；
- （七） 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%，基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；
- （八） 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 三、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

## 四、收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

## 五、收益分配中发生的费用

- （一） 收益分配采用红利再投资方式时免收再投资的费用。
- （二） 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为基金份额。

# 第十四部分 基金的费用与税收

## 一、基金费用的种类

- （一） 基金管理人的管理费；

- (二) 基金托管人的托管费；
- (三) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、席位费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (四) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (五) 基金份额持有人大会费用；
- (六) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (七) 基金的资金汇划费用；
- (八) 按照国家有关规定和基金合同约定，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

### （一）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### （二）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。



（三）本部分第一条（一）款至（八）款费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- （一）基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- （二）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- （三）会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- （四）本基金独立建账、独立核算。
- （五）本基金会计责任人为基金管理人。
- （六）基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- （一）基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- （二）会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意，并报中国证监会备案；
- （三）基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### （四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### （五）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在中国证监会指定的信息披露媒体公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值和基金份额净值。

1. 基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。
2. 基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。
3. 基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

#### （六）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

1. 基金份额持有人大会的召开；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；

8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 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、减少基金代销机构；
20. 更换基金注册登记机构；
21. 基金开始办理申购、赎回；
22. 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 基金份额上市交易；
27. 基金合同和中国证监会规定的其他事项。

#### （七）公开澄清

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

## 二、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 第十七部分 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、投资者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：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

### 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

本基金投资组合的证券可能会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。出现部分品种的交投不活跃、成交量不足的情形，此时如果基金赎回金额较大，可能因流动性风险的存在导致基金净值出现波动。本基金产品设计时充分考虑了基金流动性问题。针对巨额申购和赎回设定限制条款，在资产配置中适当加大期限短、流动性好的资产配置比例。通过上述管理措施，最大限度地减低本基金的流动性风险。

### 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：

（一）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；

（二）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；

（三）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；

（四）因为业务竞争压力可能产生的风险；

（五）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、本基金的特定风险

本基金作为混合型的基金，在投资理念上以价值投资为出发点，通过数量化、定性化的评估流程构造投资组合。在具体投资管理中，可能会由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。鉴于我国股市目前仍处于发展阶段，具有波动性较大的特征，因而本基金管理人在必要时将通过大类资产配置，降低系统性风险。

# 第十八部分 基金合同的终止与基金财产的清算

## 一、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- （一）基金份额持有人大会决定终止的；
- （二）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （三）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- （四）本基金基金合同生效后的存续期间，连续六十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人有权根据法律法规及本基金合同规定的程序，选择终止本基金，并报中国证监会备案。法律法规另有规定的，按其规定办理；
- （五）法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

## 二、基金财产的清算

### （一）基金财产清算小组

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，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

### （二）基金财产清算小组组成

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

### （三）基金财产清算小组职责：

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

**（四） 基金财产清算程序：**

1. 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
2. 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
3. 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
4. 对基金财产进行评估和变现；
5. 制作清算报告；
6. 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
7. 将清算报告报中国证监会备案并公告；
8. 对基金财产进行分配。

**三、 清算费用**

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

**四、 基金财产清算剩余资产的分配**

基金财产按下列顺序清偿：

- （一） 支付清算费用；
- （二） 交纳所欠税款；
- （三） 清偿基金债务；
- （四） 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（一）、（二）、（三）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

**五、 基金财产清算的公告**

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

**六、 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。

## 第十九部分 基金合同内容摘要

## 一、基金合同当事人的权利义务

### （一）基金管理人的权利义务

#### 1. 基金管理人享有如下权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）自本基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- （6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择、更换适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- （13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- （14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- （15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- （16）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （17）法律法规、基金合同规定的其他权利。



## 2. 基金管理人履行如下义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。
- (2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (3) 办理基金备案手续；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金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) 按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基金收益
- (7) 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；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制中期和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 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；
- (17) 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；
- (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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

(22) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利义务

(1) 依据法律法规和基金合同的规定，自基金合同生效之日起，安全保管基金财产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 按规定取得基金份额持有人名册；

(7) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2. 托管人履行如下义务

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 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；

(9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利义务

#### 1. 基金份额持有人享有如下权利：

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

#### 2. 基金份额持有人履行如下义务：

- (1) 遵守法律法规及基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

- (一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。
- (二) 除基金合同另有约定外，有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会程序；
- 8、本基金与其它基金合并；
- 9、法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

- (三) 以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

- (四) 召集方式：

- 1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

#### （五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、权益登记日；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

#### （六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授

权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

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

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；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。

#### （七） 议事内容与程序

##### 1、 议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前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：

a、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了解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 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。

## 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

### (八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

#### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

### (九) 计票

#### 1、现场开会

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

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

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人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) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## (十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等事项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。

3、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、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

4、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后两日内，由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 三、基金合同的变更与终止



#### （一）基金合同的变更

1、除基金合同另有约定外，以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）变更基金份额持有人大会程序；
- （8）本基金与其它基金合并；
- （9）法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

#### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利时，可以留置基金资产或者对基金资产的权利归属人提出请求。

### 四、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解

决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

## 五、基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

基金合同正本 1 式 6 份，除上报有关监管机构 1 式 2 份外，基金管理人、基金托管人各持有 2 份，每份具有同等的法律效力。

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

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

鉴于《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议》签署于中国银行股份有限公司成立之前，以下内容以原签署的文本为准。

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区峨山路 91 弄 98 号 201A

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1亿元人民币

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

注册资本：人民币壹仟捌佰陆拾叁亿玖仟零叁拾伍万贰仟肆佰玖拾柒元捌角叁分

经营范围：吸收人民币存款；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；居民储蓄业务；外汇存款；外汇汇款；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；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；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

## 二、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

- （1）对基金的投资范围、投资对象进行监督；
- （2）对基金投融资比例进行监督；
- （3）对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；
- （4）基金管理人应向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；
- （5）基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按约定进行监督。
- （6）基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

(7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

2. 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、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。

3. 基金托管人在上述第(1)、(2)项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及基金合同的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，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，基金托管人应当拒绝执行，并立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

4. 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

## (二) 基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

1. 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于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》、本托管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，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函并改正。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3. 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### 三、基金资产的保管

#### （一）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，未经基金管理人的合法合规指令或除法律法规、基金合同及本协议另有规定外，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
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. 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金合同生效前募集资金的验证和入账

1. 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。
2. 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

#### （三）基金的银行账户的开设和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
2. 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
3. 本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其他任何银行账户；亦不得使用基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
4. 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币结算银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

#### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人

人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### （五）基金证券账户和资金账户的开设和管理

1. 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2. 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4. 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内邮寄一份正本的原件给基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

### 四、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算和复核

1. 基金资产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数后的价值。

2. 基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算出当日的该基金份额净值，并在当日盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日盖章后以传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人，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。

3. 当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4. 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5. 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6. 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的相应责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7. 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8. 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）基金会计核算

### 1. 基金账册的建立

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

### 2. 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3. 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 日内完成；招募说明书在本基金基金合同生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告；季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。基金合同



## 五、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

1. 基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册
2. 基金权益登记日的基金份额持有人名册
3. 基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册
4. 每月最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每月结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### （三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理费用给予补偿。

## 六、适用法律与争议解决

### （一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。基金合同

## 七、托管协议的修改和终止

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

### （二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议终止：

1. 基金或基金合同终止；
2. 本基金更换基金托管人；
3. 本基金更换基金管理人；
4. 发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人拥有先进的客户服务理念，坚持客户服务与投资管理并举，以客户为中心，以客户的需求为导向，诚信、勤勉的为投资者服务，建立了国际化、标准化客户服务体系和客户服务模式。

基金管理人重视对投资者的服务，崇尚开放式基金应该是属于广大投资者的投资工具这一信念。基金管理人通过提供高水平的客户服务，帮助投资者从广度和深度上了解基金产品，培养客户对公司的信任感和忠诚度。

针对投资者的基金投资需求，基金管理人建立了专门的客户服务部门，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，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、客户服务专线

#### 1. 电话咨询

每周一至周五，上午 8：30-11:30，下午 13:00-17：00，人工咨询、客户资料修改完善服务。

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忙，可留言，基金管理人会尽快在 2 个工作日内回电，为投资者提供咨询服务。

4. 直销客户在签订远程交易协议后可以开通电话自助交易和传真交易。

### 二、信访服务

1. 投资者可以通过信函、电邮、传真等信访方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将按照紧急程度最迟不超过 7 个工作日内给予回复。

2. 对于在非工作日送达的信件，基金管理人将顺延一个工作日回复。

### 三、网站服务

1. 信息查询：基金净值、基金管理人动态、基金管理人和基金的公告、投资者个人账户信息、销售网点、企业年金信息等。

2. 基金网上交易：农行金穗卡用户、中国银联 CD 卡高级用户、兴业银行卡用户可以通过基金管理人网站实现网上开户和交易。

3. 网站客户资料修改：投资者在基金管理人网站的帐户查询栏下实现客户资料的修改和完善。

4. 客户留言版：通过网络留言，实现基金管理人与投资者之间的沟通。

5. 操作指南：无论是直销、代销，还是网上交易的投资者都能获得详细的操作流程。

6. 单据下载：直销类单据直接可以从网上获取，方便快捷。

7. 投资资讯：国泰周报、国泰快讯等资讯皆可从网站下载。

8. 短信与电子邮件定制：通过“帐户查询”和“网上交易栏目”订制免费短信和电子邮件咨询。

9. 国泰 QQ 通：投资者可以通过加入国泰 QQ 群获得及时在线服务支持。

10. 国泰在线服务：投资者可以通过网站的在线服务平台，获得及时服务。

#### 四、 短信提示服务发送服务

投资者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。

1. 净值订制：每周五晚上向所有订制本服务的投资者发送基金净值。

2. 分红提示：当旗下基金向投资者分红之前，发送短信通知，投资者可及时修改分红方式。

3. 节日祝福：过年过节，喜气洋洋，基金管理人会及时向投资者送出祝福。

4. 发行通知：每当基金管理人发行新的基金，都会在第一时间通知现有的投资者。

5. 交易确认短信通知：投资者在每次交易确认当日，均会收到预留手机的短信确认服务。

#### 五、 资料寄送服务

在从销售机构获取准确的邮政地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1. 帐户卡及开户确认书

在开户确认后的一个月内向投资者寄送帐户卡及开户确认书。

2. 基金投资者对帐单

基金投资者对账单包括季度对帐单与年度对帐单。季度对帐单每季度提供，在每季度结束后 1 个月内向有交易的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帐单，年度对帐单在每年度结束后 1 个月内对所有持有人以书面形式寄送。

3. 其他相关的信息资料

#### 六、 电子邮件电子刊物发送服务

基金管理人每周向订制邮件服务的投资者发送《国泰周报》，不定期发送《国泰快讯》和《市场异动报告》。

1. 《国泰周报》：包含基金管理人旗下基金的净值表现，公司和基金的公告，以及公司动态等内容，方便投资者及时了解各项信息。

2. 《国泰快讯》：对热点宏观经济、宏观政策、证券市场的变化进行及时点评，公司重要公告、活动第一时间通知，以及投资者关心的热点问题解答等。

3. 《市场异动报告》：对 A 股市场每日涨跌超过 2%，于当日 17:00 之前发送市场异动评论。

## 七、 交易服务

1. 多样化的委托下单方式：投资者可以通过基金管理人及其代理销售机构提供的柜台下单、电话下单、传真下单、网上交易下单等多种交易服务。

国泰基金农行卡网上直销客户可通过公司网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 进行本基金的申购、赎回、基金转换等在线交易，客户对象为全国个人投资者，资金划款渠道为中国农业银行，客户服务统一咨询电话 95599。持有农行金穗卡的投资者，可以直接登陆基金管理人网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 办理农行网上直销开户和交易开通。

国泰基金“银联通”客户可通过本公司网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 进行本基金的申购、赎回、基金转换等在线交易，客户对象为全国个人投资者，资金划款渠道为银联电子支付有限公司。国泰“银联通”资金划款渠道——银联电子支付有限公司客户服务统一咨询电话：8008203816，95516×5。持有兴业银行借记卡的投资者，可以直接登陆基金管理人网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 办理“网上开户”和“银联通”开通。

投资者欲了解更多网上交易详情，可登陆网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 或拨打电子交易热线 021-23060367。

2. 基金间转换服务：投资者可以在同一销售机构，对基金管理人旗下的基金产品进行转换，目前仅限于国泰金龙系列基金之间的转换。

3. 定期定额投资计划：投资者可以在本基金销售机构申请，约定每期扣款时间、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行帐户内自动完成扣款及基金申购申请。本基金定期定额投资计划的销售机构将另行公告。

## 八、 投诉处理受理

1. 投资者可以通过拨打基金管理人客户服务中心电话或以书信、电子邮件、传真等方式，对基金公司和销售网点所提供的服务进行投诉。

2. 对于工作日受理的投诉，原则上采取是及时当日回复，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺将在两个工作日之内做出回复。

3. 对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日回复。

## 九、 联系基金管理人

1. 网址：[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)

2. 电子邮箱：[service@gtfund.com](mailto:service@gtfund.com)

3. 客户服务热线：4008-888-688（全国免长途话费），021-33134688
4. 客户服务传真：021-23060372
5. 基金管理人办公地址：上海市延安东路 700 号港泰广场 23 楼 邮编：200001

## 第二十二部分 其他应披露的事项

1、2006 年 10 月 9 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同生效公告》，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2006 年 9 月 29 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

2、2006 年 10 月 26 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配中国工商银行股份有限公司首次公开发行 A 股的公告》，就本基金获配中国银行 A 股的数量进行了公告。

3、2006 年 11 月 10 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金开放日常申购公告》，本基金于 2006 年 11 月 13 日起开始办理日常申购交易业务。

4、2006 年 11 月 22 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金开放日常赎回公告》，本基金于 2006 年 11 月 27 日起开始办理日常赎回交易业务。

5、2006 年 12 月 4 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金第一次分红公告》，以 2006 年 12 月 1 日已实现的可分配收益为基准，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.25 元。

6、2006 年 12 月 6 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值基金在中国银行开通“定期定额投资计划”的公告》，就本基金在中国银行开通定期定额业务相关事宜进行了公告。

7、2006 年 12 月 7 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于董事变更的公告》，经本基金管理人董事会及股东会审议通过，王耀南女士当选为公司董事，周志平先生不再担任公司董事。

8、2006 年 12 月 9 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金第二次分红公告》，以 2006 年 12 月 8 日已实现的可分配收益为基准，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元。

9、2006 年 12 月 14 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于在中国建设银行开通旗下四只开放式基金“定期定额投资计划”的公告》，开通本基金在中国建设银行办理定期定额投资计划。

10、2007 年 1 月 5 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于住所变更的公告》，经公司股东会审议同意，本基金管理人住所变更为上海市浦东新区峨山路 91 弄 98 号 201A。

11、2007 年 1 月 26 日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金第三次分红公告》，以 2007 年 1 月 25 日已实现的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 4.20 元人民币。

## 第二十三部分 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十四部分 备查文件

1. 中国证监会批准国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的文件
2. 《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》
3. 《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议》
4. 关于申请募集国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金的法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照

国泰基金管理有限公司

二零零七年五月十四日