

# **国泰金马稳健回报证券投资基金 更新招募说明书**

**（2011 年第二号）**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

截止日：二〇一一年十二月十八日

## 重要提示

国泰金马稳健回报证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2004 年 4 月 27 日发布的证监基金字[2004]62 号文批准发起设立。本基金的基金合同于 2004 年 6 月 18 日成立正式生效。

国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者拟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，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人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。

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

本基金的基金合同已经根据《证券投资基金法》、《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》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 12 月 18 日，投资组合报告为 2011 年 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日。

## 目 录

|                          |    |
|--------------------------|----|
| 第一节 绪言.....              | 3  |
| 第二节 释义.....              | 3  |
| 第三节 基金管理人.....           | 5  |
| 第四节 基金托管人.....           | 16 |
| 第五节 相关服务机构.....          | 19 |
| 第六节 基金的募集与合同生效.....      | 31 |
| 第七节 基金的申购、赎回与转换.....     | 32 |
| 第八节 基金的非交易过户与转托管.....    | 38 |
| 第九节 基金的投资.....           | 39 |
| 第十节 基金的业绩.....           | 49 |
| 第十一节 基金的财产.....          | 49 |
| 第十二节 基金资产估值.....         | 50 |
| 第十三节 基金收益与分配.....        | 55 |
| 第十四节 基金费用与税收.....        | 56 |
| 第十五节 基金的会计与审计.....       | 59 |
| 第十六节 基金的信息披露.....        | 59 |
| 第十七节 风险揭示.....           | 63 |
| 第十八节 基金的终止和清算.....       | 65 |
| 第十九节 基金合同的内容摘要.....      | 67 |
| 第二十节 基金托管协议的内容摘要.....    | 79 |
| 第二十一节 对基金份额持有人的服务.....   | 84 |
| 第二十二节 其他应披露的事项.....      | 87 |
| 第二十三节 招募说明书存放及其查阅方式..... | 87 |
| 第二十四节 备查文件.....          | 88 |

## 第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）和《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》”）以及根据以上法律法规修订后的《国泰金马稳健回报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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- |               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 基金或本基金：       | 指国泰金马稳健回报证券投资基金；                      |
| 基金合同或本基金合同：   | 指《国泰金马稳健回报证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充； |
| 招募说明书或本招募说明书： | 指《国泰金马稳健回报证券投资基金招募说明书》；               |
| 发行公告或本发行公告：   | 指《国泰金马稳健回报证券投资基金发行公告》；                |
| 《基金法》：        | 指《中华人民共和国证券投资基金法》；                    |
| 《运作办法》：       | 指《证券投资基金运作管理办法》；                      |
| 《销售办法》：       | 指《证券投资基金销售管理办法》；                      |

|                   |                                                                                                    |
|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 《信息披露办法》:         | 指《证券投资基金信息披露管理办法》;                                                                                 |
| 中国证监会:            | 指中国证券监督管理委员会;                                                                                      |
| 基金合同当事人:          | 指受基金合同约束, 根据基金合同享受权利并承担义务的基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;                                               |
| 基金发起人:            | 指国泰基金管理有限公司;                                                                                       |
| 基金管理人或本基金管理人:     | 指国泰基金管理有限公司;                                                                                       |
| 基金托管人:            | 中国建设银行;                                                                                            |
| 注册登记人:            | 指国泰基金管理有限公司;                                                                                       |
| 销售机构:             | 指国泰基金管理有限公司及其委托的基金代销机构;                                                                            |
| 代销机构:             | 指接受国泰基金管理有限公司委托依据有关销售代理协议办理基金销售和基金相关业务的代理机构;                                                       |
| 个人投资者:            | 指依法可以投资证券投资基金的中国公民;                                                                                |
| 机构投资者:            | 指依法可以投资证券投资基金、在中国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体、合格境外投资者或其他组织;                                 |
| 合格境外机构投资者 (QFII): | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件, 经中国证监会批准投资于中国证券市场, 并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构; |
| 基金合同生效日:          | 指基金达到成立条件后, 基金发起人宣布基金合同生效的日期;                                                                      |
| 基金募集期:            | 指自招募说明书公告之日起到基金合同生效的时间段, 最长不超过 3 个月;                                                               |
| 存续期:              | 指基金合同生效并存续的不定期之期限;                                                                                 |
| 工作日:              | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;                                                                            |
| T 日:              | 指认购、申购、赎回或其他交易的申请日;                                                                                |
| 申购:               | 指基金存续期间投资者向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为;                                                                    |
| 赎回:               | 指基金存续期间持有本基金份额的投资者要求基金管理人接受投资者申请卖出本基金份额的行为;                                                        |
| 基金间转换:            | 指持有本基金份额的投资者要求基金管理人接受投资者申请将其持有的本基金份额转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为;                                       |

基金账户：指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有的由该注册登记人登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

指定信息披露媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网站，包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》；

法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章以及其他对契约当事人有约束力的决定、决议、通知等；

不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署并生效之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行本协议的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

## 第三节 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

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：何晔

联系电话：（021）38561743

基金管理人股权结构如下：

| 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 2011 年 12 月 18 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金

金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 18 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。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

#### （一）董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，19 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。

陈良秋，董事，大学本科。1993 年 7 月起在中国建设银行厦门市分行工作，历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006 年 10 月起在中国建投工作，任企业管理部总经理助理、副总经理、投资部负责人，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007 年 11 月起任公司董事。

徐志斌，董事，硕士研究生。2001 年 8 月起，先后在高盛集团工作，历任环球控制部高级

分析师、项目经理、团队经理；运营风险管理部总监、执行董事；市场风险管理部执行董事。2010 年 4 月起在中国建投风险管理部工作，2010 年 4 月起任中国建投风险管理部业务总监。2010 年 11 月起任公司董事。

Philippe SETBON, 董事, 硕士研究生, EFFAS 注册金融分析师。1993 年起历任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF Group) 首席执行官、ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监、GENERALI FINANCES SA 副总经理/投资总监、GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官/投资总监、GENERALI INVESTMENTS 忠利投资董事会主席/首席执行官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡) 主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Fund Management 副主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano)、TENAX(UK)、Generali Hedge Fund SICAV (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)。1994 年起历任中国保险 (欧洲) 控股有限公司总裁助理、忠利保险有限公司英国分公司、忠利亚洲中国地区总经理、中意财产保险有限公司董事、总经理, 兼任中意人寿保险有限公司董事。2010 年 6 月起任公司董事。

张和之, 董事, 硕士研究生、高级会计师。曾任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, 国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长、中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记 (正局级)、正局级调研员。2004 年 2 月起任公司董事。

金旭, 董事, 硕士研究生, 18 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党支部副书记、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、党委副书记。

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、执行院长。兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、中国法学会国际经济法学研究会常务副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、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、大连仲裁委仲裁员、北京市华贸硅谷律师事务所兼职律师等职。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 月起任公司董事。

## （二）监事会成员：

唐建光，监事会主席，大学本科。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 月进入中国建银投资有限责任公司，先后任资产处置部负责人、总经理、资产管理处置部总经理、负责人，现任中国建银投资有限责任公司企业管理部高级业务总监。2010 年 11 月起担任本公司监事会主席。

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结算部、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。2010 年 6 月起任本公司监事。

李芝樑，监事，硕士研究生。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、经理，投资银行部主任，发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004 年 2 月起任本公司监事。

沙骏，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；2008 年 2 月至 2009 年 8 月任交易部总监；2009

年9月至2011年6月任研究部总监；2011年1月起兼任投资副总监。2011年4月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。2010年11月起担任公司职工监事。

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，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007年11月起任公司职工监事。

### （三）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，18年证券从业经历。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。现任公司副总经理兼北京分公司总经理。

梁之平，本科，14年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008年4月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，2010年4月起任公司副总经理兼财富管理中心总经理，2011年1月起兼任深圳分公司总经理。

李峰，硕士研究生，15年银行证券基金从业经历。1996年5月至2003年6月任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，2003年7月至2005年5月任国联安基金管理有限公司监察稽核专员，2005年5月至2007年3月任信诚基金管理有限公司督察长，2007年4月至2009年1月任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

### （四）本基金的基金经理及助理

#### 1、现任基金经理

程洲，男，硕士研究生，CFA，10年证券基金从业经验。2000年7月至2004年3月在上海申银万国证券研究所策略研究部任策略分析师；2004年4月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理；2008年4月起任本基金的基金经理，2009年12月起兼任金泰证券投资基金的基金经理，2010年2月10日至2011年12月23日兼任国泰估值优势分级封闭的基金经理。

#### 2、历任基金经理

2004 年 6 月至 2008 年 3 月，由何江旭担任基金经理；2008 年 4 月至 2011 年 1 月 27 日由余荣权、程洲担任基金经理，2011 年 1 月 28 日起由程洲担任基金经理。

#### （五）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：

金旭女士：总经理

梁之平先生：副总经理兼深圳分公司总经理和财富管理中心总经理

张人蟠先生：总经理助理

周向勇先生：总经理助理

刘夫先生：投资副总监

沙骏先生：投资副总监

张则斌先生：财富管理中心投资总监

黄焱先生：投资副总监兼基金管理部总监

张玮先生：投资副总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 四、基金管理人的职责

（一）自基金合同生效之日起，根据本基金合同的规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务，恪尽职守，以诚实信用，勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

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

（三）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

（四）除依据《基金法》及其配套法规、《基金合同》及其他有关规定外，不得委托其他人运作基金资产；

（五）严格按照《基金法》及其配套法规、《基金合同》及其他有关规定，办理应当由基金管理人负责的与基金有关的信息披露及报告事项；

（六）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》及其配套法规、《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，不向他人泄露；

（七）法律、法规及《基金合同》规定的其他义务。

## 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，并承诺建立健全的内部控制制度，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以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- 1、将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；
- 8、除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

- 9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- 10、违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- 11、贬损同行，以提高自己；
- 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、以不正当手段谋求业务发展；
- 14、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 15、其他法律、行政法规禁止的行为。

#### （四）基金管理人关于禁止性行为的承诺

本系列基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- 1、基金之间相互投资；
- 2、基金管理人以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、基金管理人从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
- 4、基金管理人从事资金拆借业务；
- 5、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 6、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7、从事证券信用交易；
- 8、以基金资产进行房地产投资；
- 9、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 10、将基金资产投资于与基金托管人或基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- 11、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

## 六、基金经理承诺

（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）不为自己、不为其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

（四）不协助、接受委托或以其他任何形式为其它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

公司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。

## （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，公司设立的总经理办公会议、投资决策委员会、风险管理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：

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管理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

公司风险管理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。在风险管理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。

## 4、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。

#### 5、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

基金管理人声明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。

## 第四节 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张建国（代行）

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2011 年 3 月 31 日，中国建设银行资产总额 113,125.16 亿元，较上年末增加 5,021.99 亿元，增长 4.65%。2011 年一季度，中国建设银行实现净利润 472.33 亿元，较上年同期增长 34.23%；年化平均资产回报率 1.71%，年化加权平均净资产收益率 26.19%；利息净收入 716.30 亿元，较上年同期增长 25.27%；净利差为 2.58%，净利息收益率为 2.69%，分别较上年同期提高 0.28 和 0.30 个百分点；手续费及佣金净收入 231.54 亿元，较上年同期增长 37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行 9 家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874 台，拥有员工 313,867 人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010 年共获得 100 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌 500 强”列第 13 位，并被评为 2010 年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand 2010 年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为 2010 年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金

托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 195 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

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

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

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

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。
3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。
4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）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：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼    |                   |
|    |                  | 电话：021-38561759                  | 传真：021-68775881   |
|    |                  | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 |                   |
|    |                  | 联系人：蔡丽萍                          | 网址：www.gtfund.com |
| 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：王彬                           |                   |
| 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：021-38561739                  | 联系人：徐怡            |

（二）代销机构

| 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：肖钢                       | 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：张建国（代行）                  | 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：项俊波                      | 客户服务电话：95599    |
|    |              | 联系人：滕涛                         | 传真：010-85109219 |
|    |              | 网址：www.95599.cn                |                 |
| 4  | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） |                 |
|    |              | 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：胡怀邦                      | 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：汤嘉惠、虞谷云                   | 客户服务热线：95528        |
|    |                | 网址：www.spdb.com.cn            |                     |
| 8  | 华夏银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号        |                     |
|    |                | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号        |                     |
|    |                | 法定代表人：吴建                      | 客服服务热线：95577        |
|    |                | 网址：www.hxb.com.cn             |                     |
| 9  | 中信银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 |                     |
|    |                | 法定代表人：孔丹                      | 联系人：丰靖              |
|    |                | 电话：010-65550827               | 传真：010-65550827     |
|    |                | 客服电话：95558                    | 网址：bank.ecitic.com  |
| 10 | 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  |
| 11 | 北京银行股份有限公司     | 注册地址：北京市西城区金融大街 17 号首层        |                     |
|    |                | 法定代表人：闫冰竹                     | 联系人：王曦              |
|    |                | 电话：010-66223584               | 传真：010-66226045     |
|    |                | 客服电话：010-95526                |                     |
|    |                | 网址：www.bankofbeijing.com.cn   |                     |
| 12 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号       |                     |
|    |                | 法定代表人：刘安东                     | 联系人：陈春林             |

|    |                |                                             |                      |
|----|----------------|---------------------------------------------|----------------------|
|    |                | 客服电话：95580                                  | 网址：www.psbc.com      |
| 13 | 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      |
| 14 | 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 层至 21 层 |                      |
|    |                | 法定代表人：杨明辉                                   | 联系人：刘毅               |
|    |                | 电话：0755-82023442                            | 客服电话：400-600-8008    |
|    |                | 网址：www.cjis.cn                              |                      |
| 15 | 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      |
| 16 | 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     |
| 17 | 万联证券有限责任公司     | 注册地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层               |                      |
|    |                | 法定代表人：张建军                                   | 联系人：罗创斌              |
|    |                | 电话：020-37865070                             | 传真：020-22373718-1013 |
|    |                | 客服电话：400-888-8133                           | 网址：www.wlzq.com.cn   |
| 18 | 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                                    | 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    |
| 19 | 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                            |                      |

|    |                  |                                   |                      |
|----|------------------|-----------------------------------|----------------------|
| 20 | 中国银河证券股份<br>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：顾伟国                         | 联系人：田薇               |
|    |                  | 电话：010-66568430                   | 传真：010-66568536      |
|    |                  | 网址：www.chinastock.com.cn          |                      |
| 21 | 中信金通证券有限<br>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：丁思聪              |
|    |                  | 电话：0571-87112510                  | 客服电话：0571-96598      |
|    |                  | 网址：www.bigsun.com.cn              |                      |
| 22 | 申银万国证券股份<br>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 |
| 23 | 东方证券股份有限<br>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：王益民                         | 联系人：吴宇               |
|    |                  | 电话：021-63325888                   | 传真：021-63326173      |
|    |                  | 客服电话：95503                        | 网址：www.dfzq.com.cn   |
| 24 | 东吴证券股份有限<br>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   |
| 25 | 广发证券股份有限<br>公司   | 注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼      |                      |
|    |                  | 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                         | 联系人：黄岚               |
|    |                  | 电话：020-87555888                   | 传真：020-87555305      |
|    |                  | 客服电话：95575                        | 网址：www.gf.com.cn     |
| 26 | 国盛证券有限责任<br>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                |                      |

|    |              |                                                 |                    |
|----|--------------|-------------------------------------------------|--------------------|
| 27 | 民生证券有限责任公司   | 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                |                    |
|    |              | 法定代表人：岳献春                                       | 联系人：赵明             |
|    |              | 电话：010-85252656                                 | 传真：010-85252655    |
|    |              | 客服电话：400-619-8888                               | 网址：www.msza.com    |
| 28 | 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  |
| 29 | 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                                |                    |
| 30 | 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：张智河                                       | 联系人：吴忠超            |
|    |              | 电话：0532-85022273                                | 传真：0532-85022605   |
|    |              | 客服电话：0532-96577                                 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 31 | 中信证券股份有限公司   | 注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层                |                    |
|    |              | 法定代表人：王东明                                       | 联系人：陈忠             |
|    |              | 电话：010-84588888                                 | 传真：010-84865560    |
|    |              | 网址：www.ecitic.com                               |                    |
| 32 | 华泰证券有限责任公司   | 注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦                      |                    |
|    |              | 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                                      |                    |
| 33 | 长江证券股份有限公司   | 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦                          |                    |
|    |              | 法定代表人：胡运钊                                       | 联系人：李良             |

|    |              |                                        |                                                    |
|----|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------------------|
|    |              | 电话：021-63219781                        | 传真：021-51062920                                    |
|    |              | 客服电话：95579                             | 网址：www.95579.com                                   |
| 34 | 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                              | 联系人：武斌                                             |
|    |              | 电话：0755-83707413                       | 传真：0755-83700205                                   |
|    |              | 客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）        |                                                    |
|    |              | 网址：www.ghzq.com.cn                     |                                                    |
| 35 | 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：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： <a href="http://www.bhzq.com">www.bhzq.com</a> |
| 36 | 华泰联合证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、25 层 |                                                    |
|    |              | 法定代表人：马昭明                              | 联系人：盛宗凌                                            |
|    |              | 电话：0755-82492000                       | 传真：0755-82492962                                   |
|    |              | 客服电话：400-888-8555 或 95513              |                                                    |
|    |              | 网址：www.lhzq.com                        |                                                    |
| 37 | 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：石保上                              | 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                       |                                                    |
| 38 | 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                               |
| 39 | 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                    |                       |
| 40 | 兴业证券股份有限公司 | 注册地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦                   |                       |
|    |            | 法定代表人：兰荣                                   | 联系人：谢高得               |
|    |            | 电话：021-38565785                            | 传真：021-38565783       |
|    |            | 客服电话：400-888-8123                          | 网址：www.xyzq.com.cn    |
| 41 | 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    |
| 42 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元 |                       |
|    |            | 法定代表人：牛冠兴                                  | 联系人：张勤                |
|    |            | 联系电话：021-68801217                          | 传真：021-68801119       |
|    |            | 客服电话：400-800-1001                          | 网址：www.essence.com.cn |
| 43 | 东莞证券有限责任公司 | 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼               |                       |
|    |            | 法定代表人：游锦辉                                  | 联系人：梁健伟               |
|    |            | 电话：0769-22119341                           | 传真：0769-22116999      |
|    |            | 客服电话：0769-961130                           | 网址：www.dgzq.com.cn    |
| 44 | 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：常向东               |
|    |            | 电话：0471-4913998                            | 传真：0471-4930707       |
|    |            | 客服电话：0471-4961259                          | 网址：www.cnht.com.cn    |
| 45 | 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        |
| 46 | 华宝证券有限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层         |                       |

|    |              |                                       |                                                          |
|----|--------------|---------------------------------------|----------------------------------------------------------|
|    |              | 法定代表人：陈林                              | 联系人：刘闻川                                                  |
|    |              | 电话：021-50122222                       | 传真：021-50122200                                          |
|    |              | 客服电话：400-820-9898                     | 网址：www.cnhbstock.com                                     |
| 47 | 英大证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层            |                                                          |
|    |              | 法定代表人：赵文安                             | 联系人：王睿                                                   |
|    |              | 电话：0755-83007069                      | 传真：0755-83007167                                         |
|    |              | 客服电话：400-869-8698                     | 网址：www.ydsc.com.cn                                       |
| 48 | 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                    |                                                          |
| 49 | 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： <a href="http://www.hfzq.com.cn">www.hfzq.com.cn</a> |
| 50 | 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：010-66045500                                          |
|    |              | 客服电话：010-66045678                     | 网址：www.txsec.com                                         |
| 51 | 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                                       |
| 52 | 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：李薇                                                   |
|    |              | 电话：010-59355941                       | 传真：010-66553791                                          |
|    |              | 客服电话：400-889-5618                     | 网址：www.e5618.com                                         |
| 53 | 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                 |                      |
| 54 | 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   |
| 55 | 杭州银行股份有限公司   | 注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦            |                      |
|    |              | 法定代表人：吴太普                         | 联系人：严峻               |
|    |              | 电话：0571-85163127                  | 传真：0571-85179591     |
|    |              | 客服电话：400-888-8508                 | 网址：www.hzbank.com.cn |
| 56 | 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   |
| 57 | 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                  |                      |
| 58 | 西部证券股份有限公司   | 注册地址：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼  |                      |
|    |              | 法定代表人：刘建武                         | 联系人：冯萍               |
|    |              | 电话：029-87406488                   | 传真：029-87406387      |
|    |              | 客服电话：95582                        | 网址：www.westsecu.com  |
| 59 | 深圳发展银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦    |                      |
|    |              | 法定代表人：肖遂宁                         | 联系人：张青               |
|    |              | 电话：0755-82088888                  | 传真：0755-25841098     |
|    |              | 客服电话：95501                        | 网址：www.sdb.com.cn    |
| 60 | 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                                |
| 61 | 中航证券有限公司       | 注册地址：南昌市抚河北路 291 号               |                                                    |
|    |                | 法定代表人：杜航                         | 联系人：余雅娜                                            |
|    |                | 电话：0791-6768763                  | 传真：0791-6789414                                    |
|    |                | 客服电话：400-8866-567                | 网址：www.avicsec.com                                 |
| 62 | 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      |                                                    |
| 63 | 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                              |
| 64 | 方正证券股份有限公司     | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层  |                                                    |
|    |                | 法定代表人：雷杰                         | 联系人：彭博                                             |
|    |                | 电话：0731-85832343                 | 传真：0731-85832214                                   |
|    |                | 客服电话：95571                       | 网址：www.foundersc.com                               |
| 65 | 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                | 网址：www.i618.com.cn                                 |
| 66 | 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：曾明 宋永成                                         |
|    |                | 电话：0755-25188269                 | 传真：0755-25188785                                   |
|    |                | 客服电话：4001961200                  | 网址：www.961200.net                                  |
| 67 | 湘财证券有限责任公司     | 注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼  |                                                    |
|    |                | 法定代表人：林俊波                        | 联系人：钟康莺                                            |
|    |                | 电话：021-68634518                  | 传真：021-68865680                                    |
|    |                | 客服电话：400-888-1551                | 网址： <a href="http://www.xcsc.com">www.xcsc.com</a> |

|    |            |                                 |                                                          |
|----|------------|---------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 68 | 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：丁之锁                       | 联系人：陶颖                                                   |
|    |            | 电话：010-58568040                 | 传真：010-58568062                                          |
|    |            | 客服电话：010-58568118               | 网址：www.hrsec.com.cn                                      |
| 69 | 日信证券有限责任公司 | 注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号          |                                                          |
|    |            | 法定代表人：孔佑杰                       | 联系人：陈韦杉                                                  |
|    |            | 电话：010-66413306                 | 传真：010-66412537                                          |
|    |            | 客服电话：010-88086830               | 网址：www.rxzq.com.cn                                       |
| 70 | 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： <a href="http://www.jhzq.com.cn">www.jhzq.com.cn</a> |
| 71 | 广州证券有限责任公司 | 注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼 |                                                          |
|    |            | 法定代表人：刘东                        | 联系人：林洁茹                                                  |
|    |            | 电话：020-87322668                 | 传真：020-87325036                                          |
|    |            | 客服电话：020-961303                 | 网址：www.gzs.com.cn                                        |
| 72 | 大连银行股份有限公司 | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼  |                                                          |
|    |            | 法定代表人：陈占维                       | 联系人：李鹏                                                   |
|    |            | 电话：0411-82308602                | 传真：0411-82311420                                         |
|    |            | 客服电话：400-664-0099               | 网址：www.bankofdl.com                                      |
| 73 | 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                                       |

## 二、注册登记机构

| 序号 | 机构名称       | 机构信息                            |
|----|------------|---------------------------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 |
|    |            | 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 |

|  |  |                                  |                 |
|--|--|----------------------------------|-----------------|
|  |  | 法定代表人：陈勇胜                        | 传真：021-38561800 |
|  |  | 联系人：何晔                           |                 |
|  |  | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 |                 |

### 三、律师事务所和经办律师

| 序号 | 机 构 名 称        | 机 构 信 息                         |                 |
|----|----------------|---------------------------------|-----------------|
| 1  | 北京市金杜律师事<br>务所 | 注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层 |                 |
|    |                | 负责人：王玲                          | 联系人：王建平、王恩顺     |
|    |                | 电话：010-58785588                 | 传真：010-58785599 |
|    |                | 经办律师：王建平、王恩顺                    |                 |

### 四、会计师事务所和经办注册会计师

| 序号 | 机 构 名 称              | 机 构 信 息                          |                 |
|----|----------------------|----------------------------------|-----------------|
| 1  | 普华永道中天会计师<br>事务所有限公司 | 注册地址：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：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 |                 |
|    |                      | 法人代表：杨绍信                         | 联系人：单峰          |
|    |                      | 电话：021-61238888                  | 传真：021-61238800 |
|    |                      | 经办注册会计师：汪棣、单峰                    |                 |

## 第六节 基金的募集与合同生效

### 一、基金存续期间

不定期

### 二、基金类型

契约型开放式

### 三、基金的募集与合同生效

根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《国泰金马稳健回报证券投资基金基金合同》的有关规定，并经中国证监会 2004 年 4 月 27 日发布的证监基金字[2004]62 号文批准，本基金自 2004 年 5 月 13 日至 2004 年 6 月 14 日期间向社会公开发售。截止到募集期满，本基金发行净销售额为 1,230,737,843.50 元人民币。基金投资人认购款项在设立募集期产生的银行利息（共计 429,816.30 元人民币）也转为基金份额计入本基金投资人基金账户，归各基金投资人所有。按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，本基金募集期募集的基金份额及利息转份额合计为 1,231,167,659.80 份基金份额，有效认购户数共计为 24,355 户。

根据《基金法》、《运作办法》和《国泰金马稳健回报证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金满足成立条件，于 2004 年 6 月 18 日成立。

## 第七节 基金的申购、赎回与转换

### 一、申购、赎回与转换办理的场所

（一）基金管理人的直销机构。

（二）基金管理人委托的具有开放式基金销售资格的代销机构。

本基金管理人目前的直销机构分别设在上海和北京两地；委托的代销机构为建设银行、上海浦东发展银行、国泰君安证券等。本基金管理人将适时增加或调整直销机构和代销机构，并及时予以公告。

（三）国泰电子交易平台（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）。

### 二、申购、赎回与转换办理的时间

（一）开放日及开放时间

在正常情况下，本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关业务公告中规定。基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回与转换，投资者如果在开放日之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回与转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格。

国泰电子交易平台可以 7×24 小时接受个人投资人申购、赎回与转换申请，但交易日下午 15:00 以后接受的交易申请均顺延至下一个交易日处理。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整，并报中国证监会备案。

## （二）申购、赎回与转换的开始时间

本基金自 2004 年 9 月 8 日起办理日常的申购、赎回等业务，本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停申购、赎回时除外）。开放日直销业务办理时间为：9:30-15:00，代销业务由于各代理销售机构系统及业务安排等原因，投资者应以各代理销售机构具体规定的时间为准。

基金管理人开始办理各基金间的转换的具体业务办理时间在基金转换开始公告中列明。基金管理人最迟于转换开始前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格。

## 三、申购、赎回与转换的原则

（一）“未知价”原则，即本基金的申购、赎回与转换价格以受理申请当日收市后计算的基金份额资产净值为基准进行计算。

（二）“金额申购、份额赎回和份额转出”原则，即申购以金额申请、赎回和转换以份额申请，投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

（三）当日的申购、赎回与转换申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

（四）基金管理人根据基金运作实际情况在不损害基金份额持有人权益的前提下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种指定信息披露媒体公告。

## 四、申购、赎回与转换的程序

### （一）申购、赎回与转换申请的提出

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、赎回与转换的申请。

投资者申购基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资者提交赎回与转换申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的可用基金份额余额。

### （二）申购、赎回与转换申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下投资者可在 T+2 日到其办理业务的销售机构查询确认情况。

### （三）申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，投资者申购申请被销售机构受理后，销售机构负责将投资者申购款项全额扣缴。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应将按有关规定负责将赎回款项在 T+7 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

## 五、申购、赎回与转换的数额限制

（一）投资者（包括个人和机构投资者）在代销机构每次认购的最低申购金额为 1000 元（含申购费）；投资者（包括个人和机构投资者）在直销机构申购的最低金额为 1000 元；

（二）基金份额持有人在销售机构赎回时，若在销售机构（网点）保留的基金份额余额不高于 1000 份，则每次赎回申请不得低于 1000 份基金份额；若余额低于 1000 份，则赎回时需一次全部赎回；

（三）基金转换的最低申请份额为 1000 份基金单位。如投资者在单个销售网点持有单只基金的份额不足 1000 份时，需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

（四）基金管理人根据基金运作情况在不损害基金份额持有人权益的前提下可以根据实际情况对以上限制进行调整，并最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种指定信息披露媒体公告；

（五）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相应的费用后，以申请当日基金份额资产净值为基准计算，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

## 六、申购、赎回与转换费

（一）本基金根据每次申购金额的大小，申购费用等于净申购金额乘以所适用的申购费率，若投资人在一天之内发生多笔申购，则适用费率按不同的单笔分别计算。申购费由申购人承担，不列入基金资产。

本基金申购费率为：

申购规模（M）

|                 |      |
|-----------------|------|
| 50 万元以下         | 1.5% |
| 50 万元（含）-500 万元 | 1.0% |

500 万元（含）-1000 万元 0.6%

1000 万元（含）以上 1000 元（单笔）

本基金的申购费用由申购人承担，由基金管理人收取，用于市场推广、销售等各项费用。

（二）本基金赎回费随基金持有时间的增加而递减，赎回费率为：

持有时间少于一年 0.5%；

持有时间超过一年（含）少于两年 0.2%；

持有时间超过两年（含） 0

（注：1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推。）

赎回费用由赎回人承担，其中 25%归基金资产，其余部分用于支付注册登记费和手续费。

（三）转换费

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

（1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

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

2、计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

## 七、申购与赎回数额的计算方式

（一）申购份数的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 ÷ (1 + 申购费率)

（注：对于一定金额以上的申购适用绝对数额的申购费金额，净申购金额 = 申购金额 - 申购费用）

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 ÷ 申购当日基金份额净值

基金份额以四舍五入的方法保留小数点后两位。

## （二）赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×基金赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

（三）T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

## （四）单位基金资产净值的计算公式

（总资产－总负债）÷基金份额总数

## 八、申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。投资者赎回基金份额成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

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

## 九、巨额赎回的认定及处理方式

### （一）巨额赎回的认定

单个开放日基金的净赎回申请份额（指基金赎回份额与转出份额之和减去基金申购份额与转入份额之和后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，为基金的巨额赎回。

### （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份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受净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，

应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分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外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

3、当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定信息披露媒体上公告，并说明有关处理方法。

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

5、发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

## 十、拒绝或暂停申购、暂停赎回与暂停转换的情形及处理

（一）在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、不可抗力；

2、证券交易场所交易时间非正常停市，或发生其他突发情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

4、法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资者。

（二）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回与转换申请：

1、不可抗力；

2、证券交易场所交易时间非正常停市，或发生其他突发情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金连续两个开放日以上（含本数）发生巨额赎回；

4、法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

在暂停赎回与转换的情况取消时，基金管理人应及时恢复赎回与转换业务的办理。

（三）发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为需要暂停接受基金申购、赎回与转换申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的申购、

赎回与转换申请。

（四）暂停基金的申购、赎回与转换，基金管理人应及时在至少一种指定的信息披露媒体上公告。

（五）暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购、赎回与转换时，基金管理人将提前 1 个工作日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并在重新开放申购、赎回与转换日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可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、赎回与转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定信息披露媒体上连续刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并在重新开放申购、赎回与转换日公告最新的基金份额净值。

## 十一、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体办理方法参照《国泰基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定、基金代销机构的业务规则以及相关业务公告。

## 第八节 基金的非交易过户与转托管

一、基金注册登记人只受理继承、捐赠和强制执行等法律法规允许、并经基金注册登记人认可的本基金的非交易过户申请。其中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；捐赠只受理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的情形。强制执行是指司法机关或其他国家有权机关依据生效法律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、社会团体或其他组织。符合条件的非交易过户申请按基金注册登记人业务规则的有关规定办理。

二、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通买通卖的，可办理已持有基金份额的转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在原销售机构（网点）办理转托管转出手续后到其新选择的销售机构（网点）办理转托管转入手续。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构（网点）。

## 第九节 基金的投资

### 一、投资理念

价格终将反映价值。

### 二、投资目标

通过股票、债券资产和现金类资产的合理配置，高度适应中国宏观经济的发展变化。紧盯不同时期对中国 GDP 增长具有重大贡献或因 GDP 的高速增长而获得较大受益的行业和上市公司，最大程度地分享中国宏观经济的成长成果，为基金份额持有人谋求稳健增长的长期回报。

### 三、投资范围

限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金组合投资的基本范围：股票资产 40%-95%；债券资产 55%-0；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。如果法律法规对投资比例限制有最新规定的，本基金从其规定。

### 四、投资策略

本基金采取定性与定量分析相结合的方式，通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险；通过对不同时期与 GDP 增长密切相关的投资、消费、进出口等因素的深层研究，准确预期并把握对 GDP 增长贡献度大及受 GDP 增长拉动受益度大的重点行业及上市公司；通过个股选择，挖掘具有成长潜力且被当前市场低估的重点上市公司。在债券投资方面，主要基于长期利率趋势以及中短期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资管理。

## 五、类属资产配置

本基金在类属资产配置方面，遵循自上而下的投资策略。主要通过对未来宏观经济环境尤其是 GDP 增长率的分析及预测，结合证券市场的发展趋势，确定未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险收益水平，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。

国内外宏观经济和证券市场的走势表明：经济成长与股市运动具有一致性，即所谓的“经股同一”。股市是反映国民经济状况的一个窗口，股市的兴衰直接反映国民经济发展的好坏与快慢，同时，也在一定程度上影响国民经济的发展。

本基金在投资过程中，将基于宏观基本面和股市的发展趋势，并结合科学精细的估值，在维持资产配置相对稳定性的前提下，把握市场时机，在类属资产方面进行相应的配置和调整：

（一）当宏观基本面向好、GDP 稳步增长且预期股票市场趋于上涨时，本基金将采取积极进取的做法，主要投资于股票市场，分享股票市场上涨带来的收益。

（二）当宏观基本面一般、GDP 增长缓慢且预期股票市场趋于下跌时，本基金将采取相对稳健的做法，减少股票投资比例，增加债券或现金类资产比例，回避股票市场下跌的系统性风险，避免投资组合的损失。

（三）在预期利率上升、债券价格将下降时，本基金将及时调整债券组合久期，债券资产主要投资于浮息债券和久期较短的债券；

（四）在预期利率下降、债券价格将上升时，本基金的债券资产将主要投资于中长期债券，以实现较高的收益。

（五）在预期股票市场和债券市场都存在下跌风险时，本基金将减少股票和债券的持有比例，除现金资产外，增加债券回购、央行票据等现金类资产的比例。

另外，本基金还将积极参与新股申购等投资，以增加额外收益。

在类属资产配置的调整中，本基金将以定性和定量化手段为基础，定性手段主要考虑各类宏观经济政策、GDP 的增长质量等因素对债市、股市的影响，定量化手段主要根据包括宏观经济变量在内的数量化模型（如 CRR 因子模型）和资产配置理论的运用，具体分析各种经济变量对股市、债市预期收益率的影响，分析各种资产预期收益和风险。通过资产配置的调整，实现在一定风险情况下的收益最大化。

本基金运用 CRR 因子模型对股票市场收益率进行估算，CRR 模型的基本形式为：

$$R=a+b \cdot MP+c \cdot DEI+d \cdot UI+e \cdot UPR+f \cdot UTS$$

其中：R 代表股票市场的平均收益率；

MP 为工业增加值的增长率；

DEI 为预期的通货膨胀变化，通货膨胀用 CPI 价格指数计算；

UI 为未预期的通货膨胀，未预期通货膨胀=实际通货膨胀-预期通货膨胀；

UPR 为风险溢价，结合中国具体情况，用十年期国债与十年期企业债的收益之差来衡量；

UTS 为期限溢价，即长期国债和短期国债利率之差，估计时用十年期与一年期国债利率之差来度量。

如果模型计算的 R 值比实际的要低，说明市场上股票收益可能已被高估，应该减少股票市场投资比例。反之，应该增加股票投资的比例。

## 六、行业配置与个股选择

根据对我国 GDP 增长贡献度及受 GDP 增长拉动的受益度的分析以及行业发展态势等因素的综合评估，确定不同时期的行业配置比例。运用成长企业相对定价模型对相关上市公司进行相对价值评估，重点选择价值被低估的上市公司。在确保基金资产流动性的前提下，将本基金投资于股票的资产不低于 80%的比例配置在对 GDP 增长贡献度大及受 GDP 增长拉动受益度大的行业及上市公司中。

本基金对 GDP 增长贡献度以及受 GDP 增长拉动的受益度的评估分析主要建立在社科院、国家信息中心等各类统计模型（包括宏观经济增长模型等）的基础之上，结合行业增长与投资、消费、进出口之间的弹性等分析指标，得出和 GDP 增长密切相关的行业类别；综合行业基本面及相对价值等因素，最终得出相应的资产配置权重。

具体步骤：

（一）行业投资范围的选定：以我国 GDP 增长的历史数据为依据，利用时差相关分析等数量模型，分析 GDP 增长与行业增长的相关关系。根据 GDP 增长率的预测，预期行业对 GDP 增长的贡献度大小及行业受 GDP 增长拉动作用（受益度）的大小，选定对 GDP 增长累计贡献前 50%或受益度居前的行业作为基金的备选投资行业。

（二）行业价值评估：采用基本面与估值相结合，以定量数据为主，结合定性分析，全方位考察对 GDP 增长贡献度及受益度大的行业的历史收益率、股利收益率及价值和成长性等指标，判断行业的综合投资价值，得出行业资产的具体配置比例。

（三）个股遴选与定价：建立企业价值成长识别模型、企业相对价值评估模型，考虑股票的市场覆盖性、流动性和相关市场信息等因素，确定最终的股票组合。

## 七、债券及现金类资产投资范围

债券资产投资范围主要为具有良好流动性的低风险金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、AAA 级企业债、可转债等固定收益类证券，以及未来市场可能推出的其他固定收益类证券和衍生金融工具。现金类资产投资范围包括债券回购、央行票据等短期金融工具。

## 八、债券投资策略

采取久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略，在有效控制利率和信用风险的前提下，获取稳定的低风险收益。

## 九、现金类资产投资策略

采取短期利率预期策略，结合基金在现金方面的需求安排，运用现金流管理方法参与债券回购、央行票据等短期金融工具的投资，在保证基金资产安全性和流动性的前提下，获得较高的短期收益。

## 十、业绩比较基准

业绩基准=60%×【上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均】+40%×【上证国债指数】（在其它较理想的业绩基准出现以后，经一定程序会对现有业绩基准进行替换）

## 十一、风险收益特征

本基金属于中低风险的平衡型基金产品，基金的预期收益高于债券型基金，风险程度低于激进的股票型基金。

## 十二、风险管理工具

国泰基金风险控制系统

## 十三、投资决策过程

投资决策过程见图 1 所示。

### （一）投资组合构建及调整过程

基金经理小组制定年度及分阶段的项目投资计划和组合计划：项目投资计划应列明投资目

标及其实现方式。组合计划应包括对市场的看法、基金资产中的相关资产比重，并阐述理由；

基金经理小组将组合计划报投资决策委员会审批；

基金经理小组根据投资决策委员会的审批意见确定一定阶段内的投资组合计划，并组织实施；

1、投资组合调整：由于市场情况的变化，公司研究部提出报告或者基金经理小组认为现有组合需要调整的，基金经理小组可在授权范围内调整投资组合，同时将调整结果报投资决策委员会备案；

2、基金经理小组须定期评估现有投资组合的表现，并向投资决策委员会报告投资运作情况，其中月度、季度、半年度以及年度报告须以统一格式报告。

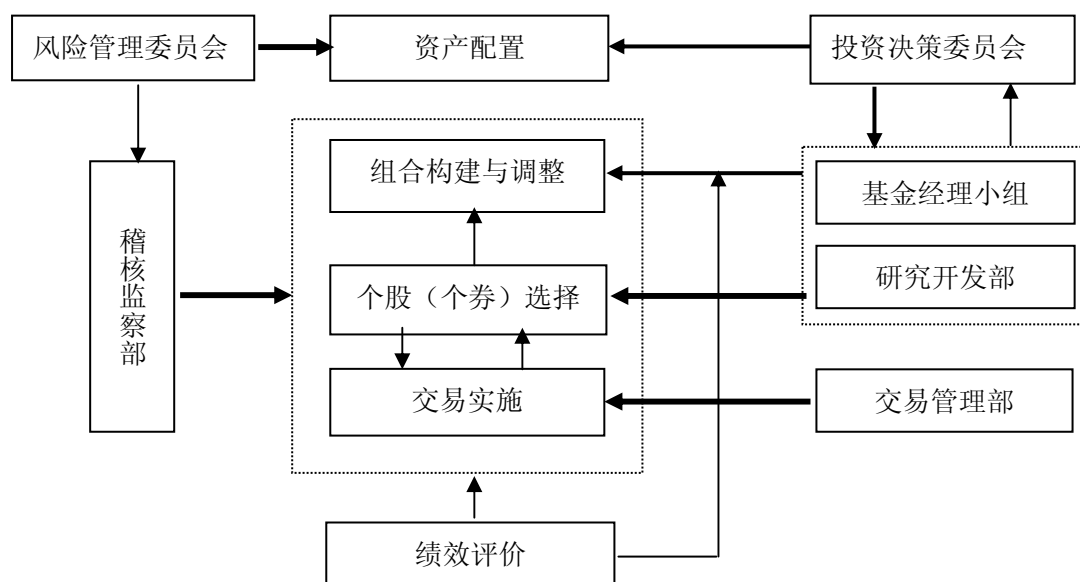


图 1：投资决策过程示意图

## （二）投资决策委员会工作程序

1、由投资决策委员会主任召集，通常每月召开 1-2 次会议，遇有重大事件，可随时召开会议；

2、每次会议所形成的决策意见须形成书面记录，并由参加会议的成员签字或主任签发。在决策记录中应明确有无不同意见，并把不同意见记录在案；

3、为支持决策的科学性和有效性，投资决策委员会可以邀请与本决策相关的人士列席，列席人员可充分发表意见，但不参与决策；

4、决策委员会每过一段时间对前阶段决策意见进行必要的检讨，总结经验，吸取教训，提高决策有效性。

## （三）基金交易过程

本基金管理人所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。交易管理部公平、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，经由交易管理部统一执行交易指令。

#### 十四、投资组合的比例限制

- （一）基金持有的股票、债券比例不低于基金资产总值的 80%；
- （二）股票资产 40%-95%；债券资产 55%-0；
- （三）现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%；
- （四）持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- （五）基金与由基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- （六）基金应当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；
- （七）法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。
- （八）在正常情况下，本基金合同生效后的三个月内应达到上述比例限制。除上述第 5 条的比例限制外，因基金规模或市场变化导致投资组合超出上述比例不在限制之内，基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。

#### 十五、投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- （一）本基金不得投资于其他基金；
- （二）本基金不得将基金资产用于抵押、担保；
- （三）本基金不得从事证券信用交易；
- （四）本基金不得进行房地产投资；
- （五）本基金不得从事可能使基金承担无限责任的投资；
- （六）本基金不得投资于与基金托管人或基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- （七）本基金不得从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

#### 十六、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

- （一）不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；
- （二）所有参与行为均应在合法合规和维护基金投资人利益的前提下进行，并谋求基金资

产的保值和增值。

## 十七、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 10 月 24 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 2011 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

### （一）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          | 5,032,021,315.29 | 84.99        |
|    | 其中：股票         | 5,032,021,315.29 | 84.99        |
| 2  | 固定收益投资        | 362,535,464.60   | 6.12         |
|    | 其中：债券         | 362,535,464.60   | 6.12         |
|    | 资产支持证券        | -                | -            |
| 3  | 金融衍生品投资       | -                | -            |
| 4  | 买入返售金融资产      | 98,760,348.14    | 1.67         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售 | -                | -            |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计  | 421,077,149.32   | 7.11         |
| 6  | 其他各项资产        | 6,439,121.29     | 0.11         |
| 7  | 合计            | 5,920,833,398.64 | 100.00       |

### （二）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  | 采掘业      | 213,768,144.63   | 3.63         |
| C  | 制造业      | 2,891,051,259.78 | 49.15        |
| C0 | 食品、饮料    | 661,764,785.33   | 11.25        |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 158,643,627.00   | 2.70         |
| C2 | 木材、家具    | -                | -            |

|     |                |                  |       |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C3  | 造纸、印刷          | -                | -     |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 286,415,499.36   | 4.87  |
| C5  | 电子             | 84,649,804.36    | 1.44  |
| C6  | 金属、非金属         | 308,124,755.99   | 5.24  |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 828,592,024.17   | 14.09 |
| C8  | 医药、生物制品        | 562,860,763.57   | 9.57  |
| C99 | 其他制造业          | -                | -     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -                | -     |
| E   | 建筑业            | -                | -     |
| F   | 交通运输、仓储业       | -                | -     |
| G   | 信息技术业          | 286,797,619.45   | 4.88  |
| H   | 批发和零售贸易        | 1,111,013,731.05 | 18.89 |
| I   | 金融、保险业         | 490,510,560.38   | 8.34  |
| J   | 房地产业           | -                | -     |
| K   | 社会服务业          | 38,880,000.00    | 0.66  |
| L   | 传播与文化产业        | -                | -     |
| M   | 综合类            | -                | -     |
|     | 合计             | 5,032,021,315.29 | 85.54 |

## （三）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  | 600153 | 建发股份 | 64,828,949 | 480,382,512.09 | 8.17         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 1,755,000  | 334,485,450.00 | 5.69         |
| 3  | 000423 | 东阿阿胶 | 6,811,224  | 282,597,683.76 | 4.80         |
| 4  | 000987 | 广州友谊 | 13,856,824 | 262,586,814.80 | 4.46         |
| 5  | 600582 | 天地科技 | 13,875,698 | 258,643,010.72 | 4.40         |
| 6  | 600271 | 航天信息 | 9,487,445  | 256,255,889.45 | 4.36         |
| 7  | 000708 | 大冶特钢 | 16,900,240 | 213,788,036.00 | 3.63         |
| 8  | 601717 | 郑煤机  | 7,820,479  | 193,244,036.09 | 3.29         |
| 9  | 002250 | 联化科技 | 9,275,376  | 191,165,499.36 | 3.25         |

|    |        |       |           |                |      |
|----|--------|-------|-----------|----------------|------|
| 10 | 000858 | 五 粮 液 | 5,162,748 | 187,407,752.40 | 3.19 |
|----|--------|-------|-----------|----------------|------|

## （四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 87,798,995.00  | 1.49         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 78,954,000.00  | 1.34         |
|    | 其中：政策性金融债 | 78,954,000.00  | 1.34         |
| 4  | 企业债券      | 19,700,000.00  | 0.33         |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,754,000.00  | 0.34         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | 156,328,469.60 | 2.66         |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 362,535,464.60 | 6.16         |

## （五）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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 113002 | 工行转债     | 1,078,210 | 109,934,291.60 | 1.87         |
| 2  | 010112 | 21国债(12) | 677,750   | 67,896,995.00  | 1.15         |
| 3  | 110015 | 石化转债     | 506,790   | 44,298,513.90  | 0.75         |
| 4  | 090205 | 09国开05   | 200,000   | 19,958,000.00  | 0.34         |
| 5  | 110222 | 11国开22   | 200,000   | 19,926,000.00  | 0.34         |

## （六）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。

## （七）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。

## （八）投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的情况；本基金投资的前十名证券的发行主体除五粮液之外，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据 2011 年 5 月 28 日五粮液发布的相关公告，该公司于 2011 年 5 月 27 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2011]17 号），经查明，五粮液信息披露存在以下四项违法事实：五粮

液关于四川省宜宾五粮液投资（咨询）有限责任公司对成都智溢塑胶制品有限公司在亚洲证券有限责任公司的证券投资款的《澄清公告》存在重大遗漏；五粮液在中国科技证券有限责任公司的证券投资信息披露不及时、不完整；五粮液 2007 年年度报告存在录入差错未及时更正；五粮液未及时披露董事被司法羁押事项。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》一百九十三条的规定，证监会决定对五粮液给予警告，并处以 60 万元罚款，对相关自然人分别处以 3~25 万元罚款。

本基金管理人此前投资该股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就五粮液受调查事件进行了及时分析和研究，认为五粮液存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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、其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,157,058.34 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,030,569.23 |
| 5  | 应收申购款   | 251,493.72   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 6,439,121.29 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1  | 113002 | 工行转债 | 109,934,291.60 | 1.87         |
| 2  | 110015 | 石化转债 | 44,298,513.90  | 0.75         |
| 3  | 110016 | 川投转债 | 991,860.80     | 0.02         |

|   |        |      |            |      |
|---|--------|------|------------|------|
| 4 | 110012 | 海运转债 | 534,342.90 | 0.01 |
| 5 | 125887 | 中鼎转债 | 347,381.60 | 0.01 |
| 6 | 110013 | 国投转债 | 222,078.80 | 0.00 |

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2011 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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    |
|----------------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 2004 年 6 月 18 日至<br>2004 年 12 月 31 日   | -3.50%  | 0.62%     | -6.93%     | 0.81%         | 3.43%   | -0.19% |
| 2005 年度                                | -0.31%  | 0.90%     | 1.18%      | 0.82%         | -1.49%  | 0.08%  |
| 2006 年度                                | 128.01% | 1.27%     | 75.25%     | 0.86%         | 52.76%  | 0.41%  |
| 2007 年度                                | 113.20% | 1.88%     | 54.80%     | 1.32%         | 58.40%  | 0.56%  |
| 2008 年度                                | -53.79% | 2.66%     | -44.25%    | 1.70%         | -9.54%  | 0.96%  |
| 2009 年度                                | 84.41%  | 1.50%     | 42.69%     | 1.13%         | 41.72%  | 0.37%  |
| 2010 年度                                | -4.71%  | 1.29%     | -8.66%     | 0.85%         | 3.95%   | 0.44%  |
| 2011 年上半年                              | -0.12%  | 1.09%     | -0.55%     | 0.65%         | 0.43%   | 0.44%  |
| 自 2004 年 6 月 18 日<br>至 2011 年 6 月 30 日 | 279.36% | 1.60%     | 84.60%     | 1.12%         | 194.76% | 0.48%  |

## 第十一节 基金的财产

### 一、基金财产

是指基金购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

## 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价值。

## 三、基金财产的账户

本基金财产由基金托管人按有关规定开立基金专用账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、注册登记人自有的资产账户以及其它基金资产账户相独立。

## 四、基金财产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人和基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人以其自有的资产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

（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）非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

# 第十二节 基金资产估值

## 一、估值日

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

## 二、估值方法

### （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：

（1）首次发行未上市的股票，按成本计量；

（2）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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

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

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

4、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### （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应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

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

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

6、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1—5 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1—5 小项规定的方法

对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（三）权证估值方法：

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

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

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

3、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（四）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。

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

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 四、估值程序

（一）基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 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。

（二）基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值

后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 五、估值错误的确认与处理

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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### （一）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

### （二）差错处理原则

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

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

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

总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

4、差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

7、按法律法规规定的其他原则处理差错。

### （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，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- 2、根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- 3、根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- 4、根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### （四）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、错误偏差达到或超过基金份额净值的 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、暂停公告净值的情形

- （一）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （二）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；
- （三）如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- （四）中国证监会认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

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

## 八、特殊情况的处理

- （一）基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第 3 项、债券估值方法的第 6 项或权证估值方法的第 2 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- （二）由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

注：根据中国证监会证监会计字[2006]23 号《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》和 2007 年 9 月 29 日《国泰基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告》更新了以上基金资产估值部分的内容。

# 第十三节 基金收益与分配

## 一、基金收益的构成

- （一）买卖证券差价；

（二）基金投资所得红利、股息、债券利息；

（三）银行存款利息；

（四）已实现的其他合法收入；

（五）持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

## 二、基金收益分配原则

（一）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（二）如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

（三）基金收益分配后基金份额资产净值不能低于发售面值；

（四）全年合计的基金收益分配比例不得低于基金年度净收益的90%；

（五）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，本基金收益每年最多分配四次；

（六）基金份额持有人可以选择取得现金分红或分红再投资的分红方式，基金份额持有人未做选择的，则现金分红方式为其默认的收益分配方式；

（七）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 三、基金收益分配方案

本基金的收益分配方案须载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

## 四、收益分配方案的确定与公告

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

# 第十四节 基金费用与税收

## 一、与基金运作有关的费用

（一）基金管理人的管理费；

- （二）基金托管人的托管费；
- （三）证券交易费用；
- （四）基金信息披露费用（国家另有规定的从其规定）；
- （五）基金份额持有人大会费用；
- （六）与基金相关的会计师费和律师费（国家另有规定的从其规定）；
- （七）照国家有关规定可以列入的其它费用。

## 二、基金运作费用计提方法、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 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 为前一日的基金资产净值

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

### （二）基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（三）上述一中（三）到（七）项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

## 三、与基金销售有关的费用

（一）本基金根据每次申购金额的大小，采用比例费率收取申购费，若投资人在一天之内如果同时有多笔申购，则适用费率按不同的单笔分别计算。

本基金申购费率为：

申购规模（M）

|                   |            |
|-------------------|------------|
| 50 万元以下           | 1.5%       |
| 50 万元（含）-500 万元   | 1.0%       |
| 500 万元（含）-1000 万元 | 0.6%       |
| 1000 万元（含）以上      | 1000 元（单笔） |

本基金的申购费用由申购人承担，由基金管理人收取，用于市场推广、销售等各项费用。

（二）本基金赎回费随基金持有时间的增加而递减，赎回费率为：

|                 |       |
|-----------------|-------|
| 持有时间少于一年        | 0.5%； |
| 持有时间超过一年（含）少于两年 | 0.2%； |
| 持有时间超过两年（含）     | 0     |

（注：1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推。）

赎回费用由赎回人承担，其中 25%归基金资产，其余部分用于支付注册登记费和手续费。

（三）转换费

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

（1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

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

2、计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

#### 四、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等不列入基金费用。

五、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费。

六、本基金运作过程中涉及的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十五节 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- （一）基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- （二）基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；
- （三）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- （四）会计制度执行国家有关的会计制度；
- （五）本基金独立建账、独立核算；
- （六）基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- （七）基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金审计

- （一）本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所有限公司及其具有证券从业资格的注册会计师对基金年度财务报表进行审计；
- （二）会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；
- （三）基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在五个工作日内公告。

## 第十六节 基金的信息披露

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

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

公开披露的基金信息包括：

### **一、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议**

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

基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，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。

### **二、基金份额发售公告**

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

### **三、基金募集情况公告**

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

### **四、基金合同生效公告**

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### **五、基金资产净值、基金份额净值**

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

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

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

### **六、基金份额申购、赎回价格**

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格

的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

## 七、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。

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

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

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

## 八、临时报告

基金发生重大事件，即可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。重大事件包括：

- （一）基金份额持有人大会的召开；
- （二）终止基金合同；
- （三）转换基金运作方式；
- （四）更换基金管理人、基金托管人；
- （五）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （六）基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- （七）基金募集期延长；
- （八）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；
- （九）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- （十）基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- （十一）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- （十二）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- （十三）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；
- （十四）重大关联交易事项；
- （十五）基金收益分配事项；
- （十六）管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （十七）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- （十八）基金改聘会计师事务所；
- （十九）变更基金份额发售机构；
- （二十）基金更换注册登记机构；
- （二十一）开放式基金开始办理申购、赎回；
- （二十二）开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- （二十三）开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- （二十四）开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- （二十五）开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- （二十六）中国证监会规定的其他事项。

## 九、基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前三十日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

## 十、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共报刊或网站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。

## 十一、中国证监会规定的其他信息

## 第十七节 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险：

#### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，主要存在以下几种风险：

1、政策风险。因国家政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致市场波动而影响基金收益，产生风险；

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到个股乃至整个行业板块的二级市场走势；

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、国际竞争风险。随着国家开放程度的提高，各行业都面临着国际竞争，上市公司的发展必然也受到发达国家公司进入中国市场的影响。尤其是中国加入 WTO（世界贸易组织）后市场开放程度加大，国内上市公司必然面临许多来自国外同类企业竞争的风险；

5、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术的更新、新产品的研究开发、高级专业人才的流动等风险。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；

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

#### （二）管理风险

1、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；

2、由于基金管理人管理的基金超过一只，因此本基金在进行具体投资操作时可能会受到其他基金投资所带来的影响（如流动性，持股上限等），尽管基金管理人内部有严格的交易规则来避免不同基金投资的利益冲突，但无法保证完全避免该影响的产生；

3、本基金是开放式基金，基金规模将随着投资者对基金份额的申购、赎回与转换而不断变

化，尽管基金管理人保持一定的现金或现金等价物储备，但若是由于投资者的连续大量赎回或转换而导致基金管理人被迫抛售股票以应付基金赎回或转换的现金需要，则可能使基金资产净值受到影响。

### （三）操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记人、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### （四）流动性风险

中国的证券市场还处在初期发展阶段，在某些情况下股票品种的流动性不是很通畅，由此可能影响到基金投资品种的日常交易及基金的申购赎回。尽管本基金管理人将通过投资组合的调整来减少该风险，但不能保证完全避免。

### （五）特定风险

1、本基金以对 GDP 增长贡献度大及受 GDP 增长拉动受益度大的行业为主要投资对象。从长期来看，资本市场和本基金的资产净值必将反映宏观经济增长。但因国内股票市场处于新兴加转轨阶段，可能在短期内存在上市公司行业代表性不强、没有足够合格条件的上市公司可供本基金投资的风险。

2、本基金是以宏观配置为主的平衡型基金，力求合理配置股票、债券和现金等类属资产的比例，以尽量回避单类资产波动过大的风险，但无法完全排除判断失误，从而加大基金资产组合的风险。

3、伴随我国经济周期的波动或宏观经济调控，不排除某些对 GDP 增长贡献度大或受益度大的行业有中短期调整或低速增长的可能，这将使本基金投资的该行业所属股票在短期内可能存在较大风险。

本基金管理人将通过深入研判和精心管理，积极规避以上特定风险，为基金份额持有人带来稳健回报。

### （六）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

## 二、声明

（一）本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承

担投资风险。

（二）除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他代销机构代理销售，但是基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十八节 基金的终止和清算

### 一、基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

（一）存续期内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于5000万元人民币，基金管理人将根据法律法规及本基金合同的规定终止本基金；

（二）基金经持有人大会表决终止的；

（三）因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

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

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

（六）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

（七）中国证监会允许的其它情况。

### 二、清算小组

（一）自基金终止之日起30个工作日内由基金管理人负责组织成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。在清算小组接管基金资产前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责

（二）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、基金管理人选定的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。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

（三）基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以

依法进行必要的民事活动。

### 三、清算程序

- （一）基金终止后，发布基金清算公告，并由基金清算小组统一接管基金资产；
- （二）基金清算小组对基金资产进行清理和确认；
- （三）对基金资产进行估价；
- （四）对基金资产进行变现；
- （五）将基金清算结果报告中国证监会；
- （六）公布基金清算公告；
- （七）进行基金剩余资产的分配。

### 四、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

### 五、基金清算剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产，按基金份额持有人持有的基金份额比例、并依照下列顺序进行分配：

- （一）支付清算费用；
- （二）缴纳所欠税款；
- （三）清偿基金债务；
- （四）剩余资产按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款1至3项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 六、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后三个工作日内公告。

### 七、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

## 第十九节 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同的当事人及权利义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

##### 1、基金管理人的权利

- （1）自基金合同生效之日起，依照有关法律法规独立管理和运用基金资产；
- （2）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金业务规则；
- （3）根据基金合同的规定获得基金管理费，收取或委托收取事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的费用；
- （4）在符合有关法律法规的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式，但基金合同规定应由基金份额持有人大会批准的，从其规定；
- （5）依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同或国家有关法律法规对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并有权向有关部门和基金份额持有人大会提议更换基金托管人，以及采取其他必要措施以保护基金及相关当事人的利益；
- （6）选择、更换基金销售代理人，并依照销售代理协议对基金销售代理人的行为进行必要的监督和检查；
- （7）选择、更换注册登记代理机构，并对注册登记代理机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- （8）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- （9）以基金的名义依法为基金进行融资；
- （10）依据基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- （11）法律、法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

##### 2、基金管理人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- （3）恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，管理和运用基金资产；
- （4）设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产，防范和减少风险；

(5) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托合格机构代为办理；

(6) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册登记业务；

(7) 建立健全内部控制制度，保证基金管理人的自有资产和基金资产相互独立，确保分别管理、分别核算、计账；保证本基金与基金管理人管理的其他基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别计账；

(8) 除依据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三方谋取利益；

(9) 除依据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，不得委托第三方管理、运作基金资产；

(10) 接受基金份额持有人、基金份额持有人大会、基金托管人依照基金合同及相关法律法规规定对基金管理人履行基金合同情况进行的监督；

(11) 按规定核算并公告基金份额资产净值；

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

(13) 严格按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定履行信息披露及报告义务；保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(14) 保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划等；除《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金管理人违反基金合同规定的保密义务；

(15) 依据基金合同规定制订基金收益分配方案，并向基金份额持有人分配基金收益；

(16) 依据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，执行基金份额持有人大会决议；确保向基金份额持有人和基金份额持有人大会提供的各项文件或资料在规定时间内发出；

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

(18) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务；基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

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

(22) 负责为基金聘请会计师事务所和律师；

(23) 职责终止时，妥善保管业务资料，及时办理基金管理业务移交手续；按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；

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

## （二）基金托管人的权利与义务

### 1、基金托管人的权利

(1) 依法持有并保管基金资产；

(2) 依照本基金合同的规定，获取基金托管费；

(3) 监督本基金的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规、违反基金合同的，不予执行，并向中国证监会报告；

(4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(5) 法律、法规及基金合同规定的其它权利。

### 2、基金托管人的义务

(1) 依法持有基金资产；

(2) 以诚实信用，勤勉尽责的原则安全保管基金资产；

(3) 设置专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

(4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其它有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 按照有关规定开立基金银行存款账户、以基金托管人与基金联名的名义开立证券账户，办理基金投资于证券的清算交割，严格执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；

(8) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其它有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；

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

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

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

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

(14) 在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(15) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(16) 按规定制作相关账册并核对基金管理人制作的相关账册；

(17) 依据基金管理人的合法合规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；

(18) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，应及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(20) 因过错导致基金资产的损失，应承担相应赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(21) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金管理人追偿；

(22) 不从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动；

(23) 法律、法规及基金合同规定的其它义务。

### （三）基金份额持有人的权利与义务

1、每份基金份额代表同等的权利和义务。

2、基金份额持有人的权利

(1) 取得基金收益；

(2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；

(3) 监督基金运作情况，知悉基金合同规定的有关信息披露内容；

(4) 按本基金合同的规定申购、赎回、转换基金份额；

- (5) 参与基金清算后的剩余资产的分配；
  - (6) 依照基金合同的规定，有权提议召集或自行召集基金份额持有人大会；
  - (7) 提请基金管理人或基金托管人履行基金合同规定应尽的义务，因基金管理人、基金托管人、销售机构、注册登记人的过错导致基金份额持有人利益受到损害时要求赔偿的权利；
  - (8) 法律、法规及基金合同规定的其它权利。
- 3、基金份额持有人的义务
- (1) 遵守基金合同；
  - (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定承担的费用；
  - (3) 以投资额为限承担基金亏损或者终止的有限责任；
  - (4) 不从事任何有损本基金及其它基金当事人利益的活动；
  - (5) 返还在基金交易过程中获得的不当得利；
  - (6) 法律、法规及基金合同规定的其它义务。

## 二、基金份额持有人大会

### （一）召开事由

有以下情形之一的，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；
- 4、更换基金管理人；
- 5、更换基金托管人；
- 6、与其它基金合并；
- 7、法律法规及基金合同规定的其他事项。

以下情形不须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、在本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或在中国证监会允许的条件下调整收费方式；
- 3、因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、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、按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）召集方式

1、在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、在更换基金管理人或基金管理人未行使或不能行使召集权的情况下，由基金托管人召集；

基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

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

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

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

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

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以按照《基金法》第七十二条第二款的规定自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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

## （三）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天，在至少一种指定媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和方式；

（2）会议拟审议的事项；

（3）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

（4）代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、委托书送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名、电话。

2、采取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、书面表决意见的寄交和收取方式。

#### （四）会议的召开

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 1、现场开会

由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合相关法律、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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%。

##### 2、通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内在指定媒体上连续公布相关提示性公告；

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

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

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律、法规、本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。

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无效表决。

3、如果开会条件达不到上述现场开会或通讯方式开会的条件，则对同一议题可履行再次开会的程序，再次开会日期的提前通知期限为 10 天，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应发生变化。

4、属于以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律、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的基金份额凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

5、属于以通讯表决方式再次召集基金份额持有人大会的，必须符合以下条件：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在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代理人，同时提交持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合相关法律、法规、本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。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项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。

基金管理人、基金托管人、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。

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。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于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。

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

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (六) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 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通过方可作出。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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

决。

### （七）计票

#### 1、现场开会

（1）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选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中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并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数进行重新清点；监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证。

#### 2、通讯方式开会

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

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，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。

除非本基金合同或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均有法律约束力。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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1、存续期内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元人民币，基金管理人将宣布本基金终止；

2、基金经持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

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

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

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、中国证监会允许的其它情况。

## （二）基金清算小组

1、自基金终止之日起 30 个工作日内由基金管理人负责组织成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。在清算小组接管基金资产前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责

2、基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、基金管理人选定的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。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

## （三）基金清算程序

1、基金终止后，发布基金清算公告，并由基金清算小组统一接管基金资产；

2、基金清算小组对基金资产进行清理和确认；

3、对基金资产进行估价；

4、对基金资产进行变现；

5、将基金清算结果报告中国证监会；

6、公布基金清算公告；

7、进行基金剩余资产的分配。

## （四）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

#### （五）基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产，按基金持有人持有的基金份额比例、并依照下列顺序进行分配：

- 1、支付清算费用；
- 2、缴纳所欠税款；
- 3、清偿基金债务；
- 4、剩余资产按基金持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款 1 至 3 项规定清偿前，不分配给基金持有人。

#### （六）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后三个工作日内公告。

#### （七）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

### 四、争议解决方式

对于因本协议的订立、内容、履行和解释或与本协议有关的争议，本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上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。

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。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式八份，每份具有同等的法律效力。基金发起人、基金管理人各持有一份，基金托管人持有二份，其余报中国证监会和其它有关监管部门。

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

## 第二十节 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：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

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

组织形式：有限责任公司

实收资本：1.1 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：张建国（代行）

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

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

### 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

（一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，对本基金的投资范围、基金资产的投资组合、所托管的基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付、基金收益分配等事项进行监督和核查。

2、基金托管人发现上述事项基金管理人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，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并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

3、基金托管人发现基金管理人上述事项有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（二）基金管理人基金托管人的业务监督、核查

1、根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金资产实行分账管理、擅自动用基金资产等行为进行监督和核查。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（三）基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

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

### 三、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金托管人应安全、完整地保管基金的全部财产。

2、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的资产。基金托管人为基金设立独立的账户，本基金财产与基金托管人的其他资产或其他业务以及其他基金的资产实行严格的分账管理。保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

3、基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（基金买卖交易所证券的清算交收除外）。

4、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托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

5、基金托管人应当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，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

6、除依据《中华人民共和国信托法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、本基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

## （二）基金设立募集期间及募集资金的验资

1、基金设立募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金设立募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、基金管理人应将属于基金资产的全部募集资金划入基金托管人以基金名义开立的基金银行账户中。

4、若基金未达到规定的募集额度不能成立，按规定办理退款事宜。

## （三）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，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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中国人民银行和中国银监会的有关规定。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

#### （五）债券托管专户的开设和管理

1、基金合同生效后，由基金管理人通过基金托管人申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。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，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

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

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据基金合同或有关法律法规的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可以存入中国证券登记结算有限责任公司及其他有权保管机构的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### （八）与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。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。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。由于合同产生的问题，由基金管理人负责处理。

### 四、基金资产净值计算与复核

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 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。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

注册登记人负责编制和保管基金持有人名册。基金合同生效日、基金权益登记日、基金持有人大会权利登记日的持有人名册，由注册登记机构负责编制。

注册登记人对基金持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

## 六、争议解决方式

对于因本协议的订立、内容、履行和解释或与本协议有关的争议，本基金合同当事人应尽可能通过协商、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上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。

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，维护基金持有人的合法权益。

## 七、托管协议的修改和终止

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

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金或本基金合同终止；
- 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、发生基金合同或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十一节 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人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、理财咨询

每周一至周五，8:30—20:00，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。

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

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、公司动态、公司和基金的公告、投资人个人账户信息、销售网点、企业年金信息等。

2、基金网上交易：工商银行借记卡用户、农业银行借记卡用户、建设银行借记卡用户、招商银行借记卡用户、兴业银行借记卡用户等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：投资人可在基金管理人网站的账户查询栏下实现客户资料的修改和完善。

4、网站“投资者教育”栏目：分为新手上路、客户服务知识库、最新热点问题、理财工具等小栏目，并提供关键字搜索，包括基金知识、交易指南、公司产品、活动动态、市场热点等信息，加强基金管理人与投资人之间的交流与沟通。

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

6、在线服务：WEBCALL 人工在线咨询服务（每周一至周五，8：30-20：00）、客户留言版、交易指南、直销类单据下载。

7、短信与电子邮件定制：通过“账户查询”系统订制免费短信和电子邮件资讯。

8、信息披露：按照法律规定披露基金管理人管理基金的持仓、资产、投资收益等信息，供投资人定期了解基金运作的最新情况。

9、理财资讯：目前理财资讯产品包括《市场周刊》、《季度策略报告》、《国泰基金快讯》、《最新市场新闻》、《市场热点要闻点评》等，与投资人展示公司的市场研究成果，交流市场研判观点。

10、互动专区：提供投资人参与公司各种理财活动的在线平台，包括最新活动介绍、现场活动报道、在线活动参与等。

#### **四、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。

#### **五、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。**

#### **六、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。

## 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直销机构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。

基金管理人向投资人提供包括工商银行借记卡用户、农业银行借记卡用户、建设银行借记卡用户、招商银行借记卡用户、兴业银行借记卡用户等可以通过公司网站进行的电子化基金交易，并享受相应交易费率优惠。投资人欲了解更多网上交易详情，可登录国泰基金网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 查询。

2、基金间转换服务：投资人可以在同一销售机构，对基金管理人旗下的除国泰金鼎价值、国泰中小盘、国泰纳指 100、国泰价值经典以外的基金产品进行转换，投资人可登录国泰基金网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 查询。若新增销售机构开通此项业务，本基金管理人或代销机构将及时予以公告。

3、定期定额投资计划：投资人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人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请。已开通定期定额的销售机构包括国泰基金网上交易（工行卡、农行卡、建行卡、招行卡）和相关代销机构，投资人可登录国泰基金网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com) 查询。若新增销售机构若开通此项业务，本基金管理人或代销机构将及时予以公告。

## 八、投诉处理受理

1、投资人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，原则上采取当日回复，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺将充分与投资人做好沟通。

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：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

## 第二十二节 其他应披露的事项

| 公告名称                                                   | 报纸                     | 日期         |
|--------------------------------------------------------|------------------------|------------|
| 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》 | 2011-06-28 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金继续参加中信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》 | 2011-06-30 |
| 国泰基金管理有限公司关于增加广州证券代理销售旗下基金并开通定期定额投资、转换业务及参加网银费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-07-06 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加厦门证券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》 | 2011-07-21 |
| 国泰基金管理有限公司关于变更中国银行直销专户银行账户账号的公告                        | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-07-29 |
| 国泰基金管理有限公司关于调整网上直销工行卡交易手续费率的公告                         | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-08-02 |
| 国泰基金管理有限公司关于在长江证券开通旗下基金定期定额投资计划及参加各项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》 | 2011-08-12 |
| 国泰基金管理有限公司关于在民生证券开通旗下基金定期定额投资业务的公告                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-08-12 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配中金黄金（600489）非公开发行 A 股的公告             | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-08-20 |
| 国泰基金管理有限公司关于增加 2 家代销渠道代理销售旗下基金并开通定期定额投资、转换业务的公告        | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-09-23 |
| 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更的公告                                  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2011-10-29 |
| 国泰基金管理有限公司关于在广发证券开通旗下基金定期定额投资计划及参加定投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》 | 2011-12-13 |

## 第二十三节 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在基金管理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。

## 第二十四节 备查文件

### 一、备查文件目录

- （一）中国证监会批准国泰金马稳健回报证券投资基金设立的文件；
- （二）《国泰金马稳健回报证券投资基金基金合同》；
- （三）《国泰金马稳健回报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、营业执照和公司章程；
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照；
- （七）中国证监会要求的其他文件。

### 二、备查文件存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点—上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼（200120）。

### 三、投资者查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

国泰基金管理有限公司

二〇一二年一月三十日