华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)招募说明书

(上接 D27 版)

(6)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

3.权证的估值

(1)配股权证的估值:从配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若收盘价等于或低于配股价,则估值为零;

(2)认沽/认购权证的估值:从持有确认日或买入日起到卖出日或行权日止,上市交易的认沽/认购权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值;未上市交易的认沽/认购权证投资采用适当的估值技术,按最能反映公允价值的价格估值;

(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。

(四)估值程序与基金净值的确认

基金的日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果报送基金托管人,基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核;基金托管人复核无误后将复核结果返回给基金管理人,由基金管理人对外公布。

(五)估值错误的处理

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

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

3.因基金份额净值计价错误而给投资者造成损失的,基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失。基金管理人在赔偿基金投资者后,有权向有关责任方追偿。基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利。

4.前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,按其规定处理。

(六)暂停估值的情形

1.基金投资涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因停市时;

2.因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资者的利益,已决定延迟估值;

4. 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;

5.中国证监会认定的其他情形。

(七)特殊情形的处理

1.基金管理人按本条第(三)款有关估值方法规定的第 1 项中的第(3)小项条款、第 2 项中的第(5)小项条款、第 3 项中的第(3)小项条款进行估值时,所造成的差异不作为基金份额净值错误处理。

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

十五、基金的收益与分配

(一)基金收益的构成

基金收益包括:

1.基金投资所得红利、股息、债券利息收入;

2.买卖证券价差收入;

3.存款利息收入;

4.其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

(二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

(三)收益分配原则

1.每份基金份额享有同等分配权。

2.如果基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。

3.基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配。

4.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

5.在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

6.基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金,选择采取红利再投资形式的,分红资金按分红权益再投资日的基金份额净值转成相应的基金份额;如果基金份额持有人未选择收益分配方式,则默认为现金方式。

投资者需注意,登记在深圳证券帐户内的基金份额只能采取现金分红方式,不能选择红利再投资。

7.法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(四)基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定,由基金托管人复核,并在报中国证监会备案后 2 个工作日内公告。基金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、分配方式等内容。

(五)基金收益分配费用

1.收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2.收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担;如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用,登记结算机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值转为基金份额。

十六、基金的费用与税收

(一)基金运作费用

1.基金费用的种类

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金上市初费及年费;

(4)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用;

(7)基金的资金汇划费用;

(8)基金收益分配中发生的费用;

(9)按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

在中国证监会允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书更新或相关公告中载明。

2.基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

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

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

(3)基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(4)本条第(一)款第 1 项中第(3)至第(9)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,并列入或摊入当期基金费用。

3.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事项发生的费用等不列入基金费用。

(二)基金销售费用

本基金集中申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金的集中申购”中“(七)集中申购费用”以及“(九)原有基金份额的折算与集中申购份额的确认 3.集中申购费用和集中申购份额的计算公式”中的相关规定。

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中的“(六)申购费与赎回费”与“(七)申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十七、基金的会计与审计

(一)基金会计年度、记账本位币与会计核算制度

1.基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

2.基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

3.会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

4.本基金独立建账、独立核算。

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

(二)基金审计

1.基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的,具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。

2.会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。

3.基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。

十八、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其实施准则、基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种指定媒体公告。

(一)基金合同、托管协议、招募说明书

基金合同、托管协议经中国证监会核准之后,基金管理人应当将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在各自公司网站上。

基金管理人应当在集中申购期开始 3 日前,将招募说明书登载在指定报刊和网站上。

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

(二)集中申购公告

基金管理人应当就集中申购的具体事宜编制集中申购公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(三)基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在指定报刊及网站上公告。

(四)基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3 个工作日,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(五)基金资产净值、基金份额净值公告

本基金合同生效后,在集中申购期开始之前,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。

自集中申购期开始之日起,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

(六)定期报告

本基金定期报告包括季度报告、半年度报告和年度报告,由基金管理人按照相关规定进行编制,经基金托管人复核后公告,同时报中国证监会备案。

1.季度报告:基金季度报告在每季度结束后的 15 个工作日内公告。

2.半年度报告:基金半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告。

3.年度报告:基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的 90 日内公告。

4.法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。

(七)临时公告

基金在运作过程中发生下列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项时,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。

1.基金份额持有人大会的召开及决议;

2.终止基金合同;

3.转换基金运作方式;

4.更换基金管理人、基金托管人;

5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

6.基金管理人股东及其出资比例发生变更;

7.基金集中申购期的延长或提前终止;

8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;

9.基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;

10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;

11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;

14.重大关联交易事项;

15.基金收益分配事项;

16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

17.基金份额净值计价错误达基金份额净值的 0.5%;

18.基金改聘会计师事务所;

19.基金变更、增加或减少代销机构;

20.基金更换登记结算机构;

21.基金开始办理申购、赎回;

22.基金申购费率、赎回费率或收费方式发生变更;

23.基金发生巨额赎回并延期支付;

24.基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

25.基金暂停办理申购、赎回;

26.基金重新开始办理申购、赎回;

27.基金暂停上市、恢复上市或终止上市;

28.基金份额折算与变更登记;

29.基金推出新业务或服务;

30.其他重大事项。

(八)澄清公告

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

(九)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十九、风险揭示

(一)投资于本基金的主要风险

1.市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括:

(1)国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格水平波动的风险。

(2)宏观经济运行周期性波动,对股票市场的收益水平产生影响的风险。

(3)上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化,从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括:

(1)市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

(2)债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

(3)债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

2.流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合,从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求,本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求,在管理现金头寸时,有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

3.积极管理风险

在精选个股的实际操作过程中,基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断,其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

4.操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

5.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。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二)声明

1.本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

2.除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过代销机构销售,但是,本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。

二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)基金合同的变更

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

但如属于基金合同第十条第(一)款规定的不需召开基金份额持有人大会的情形,可不经基金份额持有人大会决议,而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布,并报中国证监会备案。

(二)基金合同的终止

有下列情形之一的,基金合同应当终止:

1.基金份额持有人大会决定终止的;

2.基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情况。

发生上述情形之一的,基金管理人应及时公告,并按法律法规和基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起,基金合同终止。

(三)基金财产的清算

1.基金财产清算组

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

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

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

2.清算程序

(1)基金合同终止情形发生后,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(2)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;

(3)对基金财产进行评估和变现;

(4)制作清算报告;

(5)请会计师事务所对清算报告进行审计,请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对基金财产进行分配。

3.清算费用

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

4.基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案,并在 2 个工作日内公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

二十二、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

二十三、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一)红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,登记结算机构将其所获红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

(二)定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务,即投资者可通过固定的渠道,采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制。

(三)基金转换

投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。基金转换需遵守转入基金、转出基金有关基金申购、赎回的业务规则。办理基金转换业务的投资者可获得一定的费率优惠。

(四)呼叫中心

1.自动语音服务

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务,客户可通过电话查询最新公告信息、基金份额净值等信息。

2.人工座席服务

呼叫中心系统提供每周 7 天、每日 7 小时的人工服务。

客户服务热线电话:400－818－6666

传真:010－88066511

(五)网上客户服务中心

网上客户服务中心为投资者提供资讯服务以及相互交流的平台。登录网站后,投资者可以通过热点问题了解基金知识和基金业务规则,投资者还可以参加“投资者论坛”和“网上嘉宾聊天室”进行讨论和交流。

公司网址:www.ChinaAMC.com

电子信箱:service@ChinaAMC.com

(六)客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十四、其他应披露事项

(一)选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准和程序

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用,选择标准为:

1.资历雄厚,信誉良好。

2.财务状况良好,经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。

3.内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供相关信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订书面协议,报中国证监会备案并公告。

(二)席位租用期限及更换方式

席位的使用期限暂定为半年。使用期满后,基金管理人将根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价,包括:

1.提供的研究报告质量和数量;

2.研究报告被基金采纳的情况;

3.因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

4.因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

5.由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

6.开放证券经营机构资料库的情况;

7.其他可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中,管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行排名,同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯,为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求,基金管理人有权提前中止租用其交易席位。

(三)席位运作方式

基金管理人将结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量,分配基金在各席位买卖证券的交易量。

(四)其他事宜

基金管理人将根据有关规定,在基金半年度报告和年度报告中将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露,并向中国证监会报告。

二十五、招募说明书存放及查阅方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

(一)兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告

(二)中国证监会核准兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件

(三)《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

(四)《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

华夏基金管理有限公司
二〇〇七年四月二十四日

附件一:基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

(一)基金管理人

1.基本情况

名称:华夏基金管理有限公司

注册地址:北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人:凌新源

总经理:范勇宏

设立日期:1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.38 亿元

存续期间:100 年

2.基金管理人的权利

(1)运用基金财产;

(2)获得管理人报酬;

(3)依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(4)在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(5)根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定,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、中国银监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(6)在基金托管人更换时,提名新任基金托管人;

(7)选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

(8)选择、更换登记结算机构,获取基金份额持有人名册;

(9)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回申请;

(10)在法律、法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金进行融资、融券;

(11)依法召集基金份额持有人大会;

(12)法律法规、基金合同规定的其他权利。

3.基金管理人的义务

(1)依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

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

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

(6)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

(9)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

(10)按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(11)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(12)编制中期和年度基金报告;

(13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(14)保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

(15)按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

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

(17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(18)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

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

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

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

(22)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(二)基金托管人

1.基本情况

名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

住所:上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人:蒋超良

成立日期:1987 年 3 月 30 日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]25 号

组织形式:股份有限公司

注册资本:458.04 亿元

存续期间:持续经营

2.基金托管人的权利

(1)获得基金托管费;

(2)监督基金管理人对本基金的投资运作;

(3)自基金合同生效之日起,依法保管基金资产;

(4)在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

(5)根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,如认为基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定,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,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(6)依法召集基金份额持有人大会;

(7)法律法规、基金合同规定的其他权利。

3.基金托管人的义务

(1)安全保管基金财产;

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

(3)对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;

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

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

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

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

(9)建立并保存基金份额持有人名册;

(10)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(11)按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(12)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(13)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

(14)按照规定监督基金管理人的投资运作;

(15)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(16)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

(17)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

(18)因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(19)基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

(20)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(三)基金份额持有人

基金投资者自依本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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

1.基金份额持有人的权利

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;

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

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

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

(9)法律法规、基金合同规定的其他权利。

2.基金份额持有人的义务

(1)遵守法律法规、基金合同、业务规则以及其他有关规定;

(2)交纳基金申购款项及规定的费用;

(3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

(4)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

(5)执行基金份额持有人大会的决议;

(6)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人、销售机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利;

(7)法律法规、基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一)召开事由

1.有以下情形之一的,应召开基金份额持有人大会:

(1)变更基金类别;

(2)变更基金投资目标、范围或策略;

(3)变更基金份额持有人大会程序;

(4)终止基金合同;

(5)转换基金运作方式;

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(7)更换基金管理人、基金托管人;

(8)终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;

(9)法律法规或中国证监会规定的其他情形。

2.有以下情形之一的,不需召开基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费;

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;

(3)经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;

(4)经中国证监会允许,基金管理人、交易所和登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、交易、非交易过户、转托管等业务的规则;

(5)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(6)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(7)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;

(8)除法律法规、基金合同或中国证监会规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(二)召集人和召集方式

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.基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

3.代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。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 30 日向中国证监会备案。

(三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会,召集人应当至少提前 30 日,在至少一种指定媒体公告通知。

2.通知内容

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、地点和会议形式;

(2)会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;

(3)确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;

(4)代理投票授权委托书送达时间和地点;

(5)会务常设联系人姓名、电话。

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、委托的公证机构及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等。如召集人为基金管理人,还应另行通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

(四)基金份额持有人出席会议的方式

召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会,但终止基金合同、转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人必须以现场方式召开。

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应当符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定;

(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上。

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)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

(3)召集人在公证机构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;

(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)所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上。

采取通讯方式进行表决时,符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效表决;对表决事项明确放弃发表意见或表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具有效书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

如果开会时未达到上述条件,召集人可另行确定并公告重新表决的时间,且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日可保持不变。

(五)议事内容与程序

1.议事内容

议事内容限为本条前述第(一)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。

2.议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由召集人按照下列第(六)款规定程序确定和公布监票人,然后由召集人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,首先由召集人在会议通知中公布提案,然后在所通知的表决截止日期第二个工作日,由召集人在公证机构及监督人的监督下统计全部有效表决,形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机构监督下形成的决议有效。

(六)决议形成的条件、表决方式、程序

1.决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

2.表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权,基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

3.表决程序

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。计票程序如下:

(1)现场开会

基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表。如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与召集人授权的一名监督员共同担任监票人。如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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。

如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人和代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(2)通讯方式开会

计票方式为:由召集人授权的 2 名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机构对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则召集人可自行授权 3 名监督员进行计票,并由公证机构对其计票过程予以公证。

(七)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决的,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(八)法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

三、基金合同的终止

(一)基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同应当终止:

1.基金份额持有人大会决定终止的;

2.基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情况。

发生上述情形之一的,基金管理人应及时公告,并按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起,本基金合同终止。

(二)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)在基金财产清算组接管基金财产之前,基金管理人和基金托管人应按照本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)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2.清算程序

(1)基金合同终止情形发生后,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(2)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;

(3)对基金财产进行评估和变现;

(4)制作清算报告;

(5)请会计师事务所对清算报告进行审计,请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对基金财产进行分配。

3.清算费用

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

4.基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案,并在 2 个工作日内公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

因基金合同产生或与之相关的争议,基金合同当事人应通过协商或者调解解决,协商或者调解不能解决的,任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力。

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、托管协议、招募说明书、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

附件二:基金托管协议摘要

一、托管协议当事人

(一)基金管理人(或简称“管理人”)

名称:华夏基金管理有限公司

住所:北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码:100032

法定代表人:凌新源

成立时间:1998 年 4 月 9 日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.38 亿元人民币

存续期间:100 年

(二)基金托管人(或简称“托管人”)

名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

住所:上海市浦东新区银城中路 188 号 邮政编码:200120

法定代表人:蒋超良

成立时间:1987 年 3 月 30 日

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

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]25 号

注册资本:458.04 亿元

组织形式:股份有限公司

存续期间:持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。本基金投资范围、对象以及证券选择标准为:

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后,本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。

其中,本基金股票投资占基金资产的比例范围为 20%～95%,债券投资占基金资产的比例范围为 0～80%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0～20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为 0～3%,现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

根据基金合同规定,资产核心部分的投资不低于股票资产的 80%,因此,基金管理人应向基金托管人提供核心股票池明细,当基金管理人需对核心股票池进行更新时,应提前 2 个工作日通知基金托管人。

此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围;如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

1.本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;

2.本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的 10%;

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

4.本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%;

5.本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

6.本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

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

8.本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

9.本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

10.法律法规、《基金合同》规定的其他限制。

基金管理人应当自集中申购期结束后 1 个月内使本基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《基金合同》约定的投资比例规定的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对本协议第十五条基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人及时相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应以书面方式向基金托管人说明理由,在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并承担交易对手不履行合同造成的损失,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。

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

(六)基金托管人发现基金管理人的上述事项及实际投资运作中违反法律法规和《基金合同》的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以电话或书面形式向基金托管人确认,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(七)对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(八)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

2.基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。

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

四、基金财产的保管

(一)基金财产保管的原则

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2.基金托管人应安全保管基金财产,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

5.对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金资产没有到达基金托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

6.除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二)基金银行账户的变更和管理

1.基金托管人应负责本基金的银行账户的变更和管理。

2.基金托管人以本基金的名义变更基金银行账户的资料。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。

3.本基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4.基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

5.基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付,并使用交通银行企业网上银行(简称“交通银行网银”)办理托管资产的资金结算汇划业务。

(三)基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料,并对基金托管人给予积极配合和协助。

(四)基金证券账户和资金账户的变更和管理

1.基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司变更基金证券账户的资料。

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

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

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

(五)债券托管专户的变更和管理

《基金合同》生效后,基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司变更基金银行间债券市场债券托管账户的资料,并向中国人民银行报备。

(六)基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库,但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

(七)与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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。

五、基金资产净值的计算和复核

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

2.基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值,并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

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

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

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

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

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金管理人可委托登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1.基金管理人应于基金合同生效日及基金合同终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册;

2. 基金管理人应于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册;

3.基金管理人应于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册;

4.除上述约定时间外,如果确因业务需要,基金托管人与基金管理人商议一致后,由基金管理人向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册。

基金管理人和基金托管人应按照相关法律法规分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管,则按相关法律法规承担责任。

七、适用法律与争议解决方式

(一)本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

(三)除争议所涉的内容之外,本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的修改和终止

(一)托管协议的变更

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

(二)托管协议的终止

发生以下情况,本托管协议终止:

1.《基金合同》终止;

2.本基金更换基金托管人;

3.本基金更换基金管理人;

4.发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。