天治核心成长股票型证券投资基金(LOF) 上市交易公告书

基金管理人:天治基金管理有限公司　　基金托管人:交通银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司　　上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2007年7月30日　　公告时间:2007年7月24日

一、重要声明与提示

天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"基金法")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2005年11月18日登载于《中国证券报》、2005年11月21日登载于《上海证券报》、《证券时报》和天治基金管理有限公司网站(www.chinanature.com.cn)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金简称:天治核心
2、交易代码:163503
3、基金份额总额:1,095,708,524.56份(截至:2007年7月20日)
4、基金份额净值:1.3879元(截至:2007年7月20日)
5、本次上市交易份额:4,023,126.00份
6、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
7、上市交易日期:2007年7月30日
8、基金管理人:天治基金管理有限公司
9、基金托管人:交通银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况,包括:

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会2005年8月3日证监基金字[2005]134号文批准。

2、基金运作方式:上市契约型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、发售日期:2005年11月21日至2006年1月12日
5、发售价格:1.00元人民币
6、发售期限:2005年11月21日至2006年1月12日
7、发售方式:交易所(场内)发售和柜台(场外)发售
8、发售机构:
(1)深圳证券交易所(场内)发售机构
已具有基金代销业务资格的深交所会员:广发证券、国泰君安证券、国信证券、招商证券、银河证券、联合证券、中信证券、海通证券、申银万国证券、广东证券、西南证券、华龙证券、大同证券、民生证券、山西证券、北京证券、长江证券、中信万通证券、广州证券、兴业证券、天同证券、华泰证券、渤海证券、金通证券、万联证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、天一证券、上海证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、东北证券、天和证券、南京证券、长城证券、东海证券、泰阳证券、国海证券、第一证券、中原证券、中银国际证券、财富证券、国都证券、恒泰证券、华西证券、东莞证券、西北证券、国盛证券、新时代证券、齐鲁证券、华林证券、宏源证券、中金公司、广发华福证券、世纪证券、德邦证券、第一创业证券、信泰证券、金元证券、江南证券、西部证券、中信建投证券、财通证券。
场内代销机构的相关信息同时通过深圳证券交易所网站(www.szse.cn)登载。
(2)柜台(场外)发售机构
1)直销机构:天治基金管理有限公司直销中心。
2)场外代销机构:交通银行、兴业银行、中国银河证券、国泰君安证券、海通证券、中信建投证券、申银万国证券、招商证券、华泰证券、联合证券、长江证券、东北证券、第一创业证券、山西证券、华安证券、国都证券、万联证券。
9、验资机构名称:安永大华会计师事务所。
10、募集资金总额及入账情况:本次募集的净认购金额为人民币313,430,391.28元,折合基金份额313,430,391.28份;认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币63,253.16元,其中63,147.58元折算为基金份额归基金份额持有人所有,其余105.58元的利息折份额计算尾差作为其他基金资产归基金所有。本次募集所有资金已于2006年1月18日全额划入本基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况:2006年1月18日聘请安永大华会计师事务所验资,随后向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,2006年1月20日中国证监会予以书面确认,本基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2006年1月20日
13、基金合同生效日的基金份额总额:313,493,538.86份
(二)本基金上市交易的主要内容,包括:
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2007]115号
2、上市交易日期:2007年7月30日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称:天治核心
5、交易代码:163503
6、本次上市交易份额:4,023,126.00份
7、基金资产净值的披露:包括开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间的净值揭示两部分。
基金管理人每日对基金资产估值,用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统"市盈率Ⅰ"揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人对公布的基金净值负责。
考虑到本基金作为上市开放式基金在交易所交易的特性,仅揭示每日收市后的净值不能满足交易需求,基金管理人同深圳证券交易所协商一致,决定增加本基金的基金份额参考净值揭示频率,每交易日内定时揭示四次。交易时间内基金管理人将实时计算的基金份额参考净值传给深交所,深交所通过行情系统"市盈率Ⅱ"定时揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考,基金管理人、基金托管人并不对其准确性负责,亦不对其交易作出任何保证或担保。
8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2007年7月20日的场内基金份额持有情况:
场内基金份额持有人户数:249户
平均每户持有的场内基金份额:16,157.13份
场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有180.00份,占0.0045%
场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有4,022,946.00份,占　99.9955%
场内基金前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额的比例
1	张文凯	641,454.00	15.94%
2	郑中健	214,341.00	5.33%
3	吴伟胜	187,945.00	4.67%
4	霍玉书	183,128.00	4.55%
5	吕瑞芳	153,462.00	3.81%
6	刘　宁	137,246.00	3.41%
7	乔来智	136,971.00	3.40%
8	尹　茵	126,014.00	3.13%
9	李　肯	102,748.00	2.55%
10	莫秋梅	83,058.00	2.06%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:天治基金管理有限公司
2、法定代表人:赵玉彪
3、总经理:祖煜
4、注册资本:1.3亿元人民币
5、注册地址:上海市延平路83号501-503室
6、设立批准文号:证监基金字[2003]73号
7、法人营业执照文号:3101106000146673
8、经营范围:基金管理业务,发起设立基金,中国证监会批准的其他业务。
9、股东及持股比例:吉林省信托投资有限责任公司出资人民币6000万,占注册资本的46.16%,中国吉林森林工业集团有限责任公司出资人民币5000万,占注册资本的38.46%,吉林市国有资产经营有限责任公司出资人民币2000万,占注册资本的15.38%。
10、内部组织结构及职能:公司下设投资管理部、研究发展部、定量研究部、市场营销部、机构理财部、基金结算部、信息技术部、监察稽核部和综合管理部共九个职能部门以及北京分公司。其中,投资管理部负责基金资产的投资运作和交易;研究发展部负责宏观经济、行业及上市公司、投资策略等方面的研究;定量研究部为基金产品设计、基金投资管理与决策、基金投资的风险控制提供定量研究支持;市场营销部负责基金销售、营销策划和客户服务等工作;监察稽核部负责公司和基金的监察稽核工作。
11、人员情况:截止2007年7月20日,公司现有人员共51名,大学本科及以上学历46名,占员工总数90%。
12、信息披露负责人及咨询电话:张丽红,021-64371155。
13、基金管理业务情况简介:截至目前,公司管理天治财富增长证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金、天治天得利货币市场基金和本基金四只开放式基金,管理资产规模约18.71亿元人民币。
14、本基金基金经理:余明元先生:经济学博士,多年证券、基金从业经验。曾任职于国元证券研发中心、投资部,期间主要从事证券分析、研究和投资管理等工作。2003年2月起就职于天治基金管理有限公司,现任天治基金管理有限公司投资管理部总监兼本基金基金经理。自2006年1月20日至今任本基金基金经理。
(二)基金托管人
1、名称:交通银行股份有限公司
2、法定代表人:蒋超良
3、注册资本:458.04亿元
4、注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
5、专门基金托管部门负责人及人员情况:交通银行股份有限公司总行设资产托管部,负责人阮红女士。资产托管部现有员工80余人,具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬。
6、信息披露负责人及咨询电话:张咏东,021-68888917。
7、托管业务情况简介:截止2006年底,交通银行股份有限公司共托管证券投资基金35只,QFII基金2只,同时交通银行股份有限公司也是全国社会保障基金两家托管行之一。托管总规模1100余亿元。
(三)基金验资机构
1、名称:安永大华会计师事务所
2、法定代表人:沈钰文
3、注册地址:上海市长乐路989号世纪商贸广场45楼
4、经办注册会计师:徐艳、蒋艳华
5、电话:021-24052000

六、基金合同摘要

(一)基金合同当事人的权利和义务
1、基金份额持有人权利
(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)法律法规和基金合同规定的其他权利。
2、基金份额持有人的义务
(1)遵守基金合同;
(2)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
(3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
(4)不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动;
(5)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
(6)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(7)法律法规和基金合同规定的其他义务。
3、基金管理人的权利
(1)依法募集基金;
(2)自基金合同生效之日起,根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产;
(3)依照法律法规和基金合同获得基金管理费以及法律法规和基金合同规定的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)召集基金份额持有人大会;
(6)依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;
(9)依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(10)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(11)在符合有关法律法规和基金合同的前提下,制订和调整开放式基金业务规则,决定和调整基金的除托管费率和调高管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(16)法律法规和基金合同规定的其他权利。
4、基金管理人的义务
(1)办理基金备案手续;
(2)自基金合同生效之日起,以诚实信用,勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
(3)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;
(4)办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反本基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产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)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制基金季度报告、半年度报告和基金年度报告;
(11)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)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;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计帐册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)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,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿,但除法律法规另有规定外,不连带承担基金托管人的责任;
(22)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(23)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还基金认购人;
(24)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(25)不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
(26)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;
(27)法律法规和基金合同规定的其他义务。
5、基金托管人的权利
(1)自本基金合同生效之日起,依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
(2)依基金合同约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;
(5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;
(6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金的债券及资金的清算;
(7)提议召开基金份额持有人大会;
(8)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(9)法律法规和基金合同规定的其他权利。
6、基金托管人的义务
(1)以诚实信用,勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的资产托管部,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)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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
(4)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,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;
(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予以保密,不得向他人泄露;
(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;
(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人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;
(11)按有关规定,保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
(12)建立并保存基金份额持有人名册;
(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14)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;
(15)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;
(16)按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作;
(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
(19)因违反基金合同导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(20)监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人的利益向基金管理人追偿,除法律法规另有规定外,不连带承担基金管理人的责任;
(21)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(22)不从事任何有损基金和其他基金当事人利益的活动;
(23)法律法规和基金合同规定的其他义务。
(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
2、召开事由
当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:
(1)提前终止基金合同;
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人;
(4)转换基金运作方式;
(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
(6)变更基金类别;
(7)变更基金投资目标、范围或策略;
(8)变更基金份额持有人大会程序;
(9)对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项;
(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就涉及本基金的同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
(12)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,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)在基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
(4)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
(5)除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。
3、会议召集人及召集方式
(1)除法律法规规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;
(2)基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;
(3)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,应当由基金托管人自行召集。
(4)代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。
(5)如在上述第4条情况下,基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。
(6)基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
(1)召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30天,在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
1)会议召开的时间、地点、方式;
2)会议拟审议的事项、议事程序;
3)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及联系电话。
(2)采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
5、基金份额持有人出席会议方式
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。
会议的召开方式由会议召集人确定,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。
(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出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法律法规、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利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%(含50%)。
如上述条件未能满足,则召集人应当将会议至少推迟15个工作日后重新召集,并公告重新开会的时间和地点,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变。重新以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会,仍应满足上述条件。
(2)通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯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(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)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小于在权益登记日基金总份额的50%(含50%);
如上述条件未能满足,则召集人应当将会议至少推迟15个工作日后重新召集,并公告重新开会的时间和地点,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变。重新以通讯方式再次召集基金份额持有人大会的,仍应满足上述条件。
4)上述第3)项中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法律法规、基金合同和会议通知的规定;
5)会议通知公布前报中国证监会备案。
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,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决权为有效出席的投资者;表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
8、计票
(1)现场开会
1)如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要求进行重新清点。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)通讯开会
在通讯开会的情况下,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。
9、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。
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中国证监会指定的信息披露媒体上公告。
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对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。
如果采用通讯方式进行表决,那么在公告基金份额持有人大会决议时,须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。
(三)基金收益分配原则、执行方法
1、收益分配原则
(1)每一基金份额享有同等分配权;
(2)基金收益分配比例按有关规定制定,年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%;
(3)基金投资当期亏损,则不进行收益分配;
(4)基金当年收益应先弥补以前年度亏损后,才可进行当年收益分配;
(5)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;
(6)基金收益分配方式:基金份额登记在注册登记系统的投资者可以选择现金分红或红利再投资;基金份额登记在证券登记结算系统的投资者只能选择现金分红;本基金分红的默认方式为现金分红;投资人选择红利再投资时,分配的基金收益以权益登记日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资;
(7)基金收益每年最多分配6次,但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配。
(8)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
2、收益分配方案
基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。
3、收益分配方案的确定、公告与实施
本基金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,基金管理人应在2日内公告并报中国证监会备案。
4、基金收益分配中发生的费用
(1)采用现金分红方式,可从现金红利中提取一定的数额或比例用于支付注册登记手续费。如收取该项费用,具体提取方式在定期更新的招募说明书或公告中规定。
(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。
(四)基金费用的种类、计提方法、计提标准和支付方式
1、基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金证券交易费用;
(4)基金份额持有人大会费用;
(5)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
(6)基金合同生效后的信息披露费;
(7)基金上市的费用;
(8)按照国家有关规定和基金合同约定可以在基金资产中列支的其它费用。
2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
本基金的管理费按基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.2%÷当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×2.5‰÷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
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
(3)上述基金费用的种类中第3-8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。
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财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。
基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。
4、费用调整
基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。
(五)基金财产的投资方向和投资限制
1、投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
通过将部分产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票,并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数(新华富时中国A200指数)的业绩表现,在控制相对市场风险的前提下,追求中长期的资本增值。
2、投资限制
(1)本基金的投资组合遵循以下限制:
1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
2)本基金与基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
3)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
4)不违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定;
5)中国证监会规定禁止的其他情形。
在本基金合同生效之日起6个月内,基金管理人将使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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第1、2项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的,基金管理人应在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门取消或调整上述比例限制的,从其规定。
(2)基金投资禁止行为
1)承销证券;
2)向他人贷款或者提供担保;
3)从事承担无限责任的投资;
4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
8)依照法律法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
(六)基金资产净值的计算方法和公告方式
1、基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
2、公告方式
本基金合同生效后,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,并在该市场交易日的次日,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。
(七)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式
1、基金合同的变更
(1)除非法律法规和基金合同另有规定,对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会核准或备案。
(2)依现行有效的有关法律法规,对基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。
(3)除依本基金合同和依现行有效的有关法律法规,对基金合同的变更须基金份额持有人大会决议通过和须报中国证监会核准以外的情形,经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更后公布,并报中国证监会备案。
2、基金合同的终止
有下列情形之一的,基金合同应当终止:
(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6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
(3)基金合同约定的其他情形;
(4)中国证监会允许的其他情况。
3、基金财产的清算
(1)基金财产清算小组:自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
(2)基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
(3)基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。
(4)基金财产清算程序:
1)基金合同终止后,由基金财产清算小组统一接管基金;
2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
3)对基金财产进行估值和变现;
4)对基金财产进行分配;
5)制作清算报告;
6)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
7)将清算报告报中国证监会备案并公告。
4、清算费用
清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。
5、基金财产清算剩余资产的分配
基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
6、基金财产清算的公告
基金财产清算报告在基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。
7、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。
(八)争议解决方式
各方当事人同意,因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲