

# **东方增长中小盘混合型开放式证券投资 基金招募说明书（更新） （2014年第2号）**

**基金管理人：东方基金管理有限责任公司**

**基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司**

**二〇一五年二月**

## 重要提示

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2011 年 10 月 20 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】1687 号）和《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2011】860 号）的核准募集。本基金基金合同于 2011 年 12 月 28 日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，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。

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新基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）本基金的意愿、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要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 9 月 30 日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为 2014 年 12 月 28 日。

## 目 录

一、绪 言 .....	3
二、释 义 .....	3
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	18
五、相关服务机构 .....	21
六、基金的募集与基金合同的生效 .....	37
七、基金份额的申购与赎回 .....	38
八、基金的投资 .....	45
九、基金的业绩 .....	59
十、基金的财产 .....	61
十一、基金资产估值 .....	61
十二、基金收益与分配 .....	68
十三、基金的费用与税收 .....	69
十四、基金的会计与审计 .....	71
十五、基金的信息披露 .....	71
十六、风险揭示 .....	76
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	78
十八、基金合同的内容摘要 .....	80
十九、基金托管协议的内容摘要 .....	99
二十、对基金份额持有人的服务 .....	120
二十一、其他应披露事项 .....	122
二十二、招募说明书存放及查阅方式 .....	123
二十三、备查文件 .....	123

## 一、绪 言

《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定以及《东方增长中小盘混合型开放式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合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

在《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书》中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

1. 基金或本基金：指东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金
2. 基金管理人或本基金管理人：指东方基金管理有限责任公司
3. 基金托管人或本基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司
4. 基金合同：指《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充

5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书》，及其定期的更新
7. 基金份额发售公告：指《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时做出的修订
9. 《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10.《销售办法》：指2013年2月17日经中国证券监督管理委员会第28次主席办公会议通过，自2013年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订
- 11.《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订
- 12.《运作办法》：指2014年7月7日由中国证监会公布并于2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订
13. 中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
15. 银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会
16. 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法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
17. 个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
18. 机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记或经政府有关部门批准设立的机构
19. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可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的机构投资者

20. 基金投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称

21. 基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

22. 基金销售业务：指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23. 销售机构：指直销机构和代销机构

24. 直销机构：指东方基金管理有限责任公司

25. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26. 基金销售网点：指直销机构及代销机构的代销网点

27. 份额登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

28. 份额登记机构：指办理份额登记业务的机构。本基金份额登记机构为东方基金管理有限责任公司

29. 基金账户：指份额登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

30. 基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

31. 基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，中国证监会书面确认的日期

32. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

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

34. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36. 日/天：指公历日

37. 月：指公历月

38. T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

39. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
40. 开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
41. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
42. 认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为
43. 申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为
44. 赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为
45. 基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为
46. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施变更所持基金份额销售机构的操作
47. 巨额赎回：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
48. 元：指人民币元
49. 基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额
50. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
51. 基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的净资产值
52. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值
53. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
54. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、基金管理人、基金托管人的互联网网站及其它媒体
55. 《业务规则》：指《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守
56. 不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，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、法律法规变化、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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立日期：2004 年 6 月 11 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：50 年

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80 号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：110000007042263

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

股东名称	出资金额（人民币）	出资比例
东北证券股份有限公司	12,800 万元	64%
河北省国有资产控股运营有限公司	5,400 万元	27%
渤海国际信托有限公司	1,800 万元	9%
合计	20,000 万元	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设总经理办公



会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、风险管理部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、权益投资部、固定收益部、交易部、专户业务部、指数与量化投资部、公募业务部十四个职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司；公司设督察长，分管风险管理部、监察稽核部，负责组织指导公司的风险管理和监察稽核工作。

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1. 董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人；现任东方基金管理有限责任公司董事长，兼任东北证券股份有限公司副董事长、吉林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会理事、东方汇智资产管理有限公司董事长。

张兴志先生，董事，硕士，研究员。历任吉林省经济体制改革委员会宏观处处长，吉林省体改委产业与市场处处长，吉林亚泰（集团）股份有限公司总裁助理、副总裁，东北证券有限责任公司副总裁；现任东北证券股份有限公司副总裁、纪委书记，兼任吉林省证券业协会监事长，东证融达投资有限公司董事、副总经理。

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务部负责人、财务总监，东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司副总裁，兼任吉林省总会计师协会副会长、吉林省会计学会常务理事、吉林省金融学会理事、吉林省见义勇为基金会理事、吉林省消费者协会常务理事、吉林省青联委员、吉林大学研究生校外合作导师、东证融通投资管理有限公司董事、东证融达投资有限公司董事。

郭兴哲先生，董事，硕士，高级经济师。历任唐山钢铁公司技术员、调度，河北省科教部干部，河北省经济体制改革委员会干部，河北省体改委证管办副主任，河北省证券委员会国内业务处处长、综合处处长，中国证监会石家庄特派员办公室综合处调研员，河北证券有限责

任公司总裁、顾问；现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、党委常委，兼任河北国控化工有限公司党委书记、董事长；河北卓城企业管理服务有限公司董事、总经理。

彭铭巧女士，董事，经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员，特区时空杂志社编辑，国泰君安证券公司海口营业部研究员，海航集团有限公司证券业务部研究室经理，海航集团财务有限公司投资银行部理财主管；现任渤海国际信托有限公司投资部总经理，兼任国都证券有限责任公司监事。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业（集团）总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员（副部级），中国工商银行党委副书记、副行长、中央金融工委委员（副部级），工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长（中组部任命、副部级）、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事，兼任山东博汇纸业股份有限公司独立董事、石嘴山银行股份有限公司独立董事。

孙晔伟先生，董事，经济学博士。历任吉林省社会科学院助理研究员，东北证券股份有限公司投资银行部经理，东方基金管理有限责任公司督察长，新华基金管理有限公司总经理助理，安信证券股份有限公司基金公司筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司副总经理；现任东方基金管理有限责任公司总经理，兼任东方汇智资产管理有限公司董事。

## 2. 监事会成员

赵振兵先生，监事会主席，本科，高级经济师。历任河北华联商厦部门助理、副经理、副总经理，河北省商贸集团经营二公司副总经理，河北省工贸资产经营有限公司改革发展处副处长，河北省国有资产控股运营有限公司企业管理部副部长、资产运营部部长；现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、河北省国控矿业开发投资有限公司董事。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，20年金融、证券从业经历；现任本公司风险管理部总经理。

肖向辉先生，监事，本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行；现在本公司登记清算部任职。

### 3. 其他高级管理人员

孙晔伟先生，总经理，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，副总经理，吉林大学行政管理硕士，具有 22 年证券从业经历。历任吉林物贸股份有限公司投资顾问，君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员，吉林省信托营业部筹建负责人，新华证券股份有限公司长春同志街营业部副经理、经理，东北证券股份有限公司杭州营业部经理、营销管理总部副经理、经理。2011 年 5 月加盟本公司，历任总经理助理兼市场总监和市场部经理。

陈振宇先生，副总经理，华中理工大学经济学硕士，具有 20 年证券从业经历。历任大鹏证券有限责任公司证券投资一部经理、深圳深南中路营业部总经理、资产管理部总经理等职，招商证券股份有限公司深圳福民路营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部负责人、证券投资部负责人，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理。2014 年 2 月加盟本公司，历任特别助理。

秦熠群先生，副总经理，中央财经大学经济学博士。历任中央财经大学经济学院副院长、学校分部副主任等职务。2011 年加盟本公司，历任董办主任、董秘、总经理助理等职务，期间曾兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总经理职务。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。具有 17 年证券从业经历，曾任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004 年 6 月加盟本公司，历任财务主管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

### 4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
呼振翼(先生)	2011 年 12 月 28 日起至今	对外经济贸易大学金融学硕士，18 年期货和证券从业经历。历任高斯达期货公司投资经理，金鹏期货公司投资经理，海南证券研究员，湘财证券研究员、投资理财部经理，民生证券研究员、行业组组长。2010

		<p>年5月加盟东方基金管理有限责任公司，历任研究员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。现任投资决策委员会委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	---

#### 5. 投资决策委员会成员

陈振宇先生，副总经理，投资决策委员会主任委员，简历请参见其他高级管理人员介绍。

于鑫先生，总经理助理，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。清华大学IMBA，CFA，13年证券从业经历。历任世纪证券有限公司资产管理部投资经理。2005年加盟东方基金管理有限责任公司，历任基金管理部经理、投资副总监、投资总监、投资决策委员会委员、投资决策委员会副主任委员、东方精选证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。

张岗先生，权益投资部总经理，东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。西北大学经济学博士，12年证券从业经历。历任天治基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监，建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部经理，东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。

李仆先生，固定收益部总经理，投资决策委员会委员，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。14年证券从业经历，历任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝岛（香港）贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014年2月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任特别顾问。

王丹丹女士，固定收益部副总经理，东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理，投资

决策委员会委员。中国人民银行研究生部金融学硕士，8年证券从业经历。2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券研究员、债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。

刘志刚先生，指数与量化投资部总经理，兼任专户业务部总经理，投资决策委员会委员。吉林大学数量经济学博士，6年基金从业经历。历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013年5月加盟东方基金管理有限责任公司。

呼振翼先生，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、本基金基金经理，投资决策委员会委员。简历请参见本基金基金经理介绍。

#### 6. 上述人员之间均不存在近亲属关系

### （三）基金管理人职责

#### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (3) 依照有关规定为基金的利益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和基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
- (5) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
- (6) 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；
- (7) 自行担任基金份额登记机构或选择、更换份额登记机构，并对份额登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (8) 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；
- (9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；



- (10) 依法召集基金份额持有人大会；
- (11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；
- (13) 法律法规规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；
- (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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，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小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 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人；
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (27) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### 3. 基金管理人的承诺

(1) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

(2) 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (3) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (4) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (4) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (5) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (6) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

4. 本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利益；



- (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) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

##### 1. 内部控制制度

###### （1）内部控制的原则

- ①健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- ②有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。
- ③独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- ④相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
- ⑤成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

###### （2）内部控制的主要内容

### <1>控制环境

①控制环境构成公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主透明的决策程序和管理议事规则，高效严谨的业务执行系统，以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度，严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度，确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

### <2>风险评估

内部稽核人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

### <3>组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

第一层次：董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导；

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会代表董事会在董事会授权范围内对公司和基金运作的合法合规性及风险控制状况进行评估，并督促经理层、督察长落实或改进。

督察长根据法律、法规的规定，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况，行使法律、法规及中国证监会和公司章程规定的职权。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和风险与监察稽核部门；

①总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构，并负责公司层面风险管理工作。

②风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准，划分和量化市场风险，并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

③风险与监察稽核部门，负责对公司、基金运作和资产管理的合法合规性、内部控制制度的有效性及公司日常风险和基金投资的绩效评价进行风险管理、监察、稽核。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各业务部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订和执行本部门的业务管理办法和操作流程，对各自业务中潜在风险进行自我检查和控制。

#### <4>制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

①内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

②内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

③业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### <5>信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

### 2. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：470亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

### （二）主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。（三）基金托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚

持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2014 年 6 月 30 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 27 只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利分级债券型证券投资基金（164208）、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金（162105）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）。托管的特定客户资产管理计划共 48 只，其中 11 只已到期，包括南方-灵活配置之出口复苏 1 号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信-邮储银行-灵活配置 1 号客户资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置 1 号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置 2 号资产管理计划、南方灵活配置 2 号资产管理计划、鹏华基金鹏诚理财高息债分级 2 号资产管理计划、华安基金-增益分级债券型特定多个客户资产管理计划、农银汇理-邮储-国投信托雨燕 1 号悦达债券 1 号资产管理计划、华商-邮储-瑞熙 1 号一对一资产管理计划等。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 6,767.05 亿元。（四）基金托管人的内部控制制度

#### 1. 内部控制目标



作为基金托管人，中国邮政储蓄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。

## 2. 内部控制组织结构

中国邮政储蓄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。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备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的工作职权和能力。

## 3. 内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、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员负责，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。

### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1. 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。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，对违法违规行为及时予以风险提示，要求其限期纠正，并报告中国证监会。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。

#### 2. 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）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）直销机构

#### 1. 柜台交易：

名称：东方基金管理有限责任公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 3 层

法定代表人：崔伟

联系人：孙志娟

电话：010-66295921

传真：010-66578690

网站：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)或[www.df5888.com](http://www.df5888.com)

#### 2. 电子交易：

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

本公司网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### （二）代销机构

#### 1. 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：王硕

传真：010-68858117

客户服务电话：95580

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

#### 2. 中国农业银行股份有限公司

住所：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：刘士余



客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

3. 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

4. 中国建设银行股份有限公司

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号楼长安兴融中心

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

5. 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

联系人：杨成茜

电话：010-57092619

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

**6.** 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：孔超

电话：010-66223588

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

7. 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：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：常振明

客户服务电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

8. 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

9. 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人：廖玉林

联系人：陈幸

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

客户服务电话：4001196228（全国）、96228（广东省内）

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

10. 吉林银行股份有限公司

注册地址：吉林省长春市东南湖大路1817号

办公地址：吉林省长春市东南湖大路1817号

法定代表人：唐国兴

联系人：孟明

电话：0431-84992680

传真：0431-84992649

客户服务电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

网址：www.jlbank.com.cn

#### 11.东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

#### 12.中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京朝阳区亮马桥路 48 号

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833799

客户服务电话：95548

网址：www.ecitic.com

#### 13.申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：李清怡

电话：021-54041654

传真：021-54033888

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

14. 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

15. 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-23219100

客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

16. 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街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

客户服务电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

17.光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

18.国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676767

传真：021-38670767

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

19.中信证券(浙江)有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系人：周妍

电话：0571-86078823

传真：0571-85106383

客户服务电话：95548

网址：www.bigsun.com.cn

20.国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 178 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 178 号

法定代表人：蔡咏

联系人：李蔡

电话：0551-68167423

传真：0551-68167431

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

#### 21. 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

#### 22. 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

#### 23. 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

#### 24.国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

#### 25.长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：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：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

#### 26.招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：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：林迎生

电话：0755-82943666



传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

#### 27.华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路90号

办公地址：南京市中山东路90号

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95577

网址：www.htsc.com.cn

#### 28.齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

#### 29.江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：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：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

30.宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

31.华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

32.五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：张永衡

联系人：高克南

电话：0755-82545707

传真：0591-87383610

客户服务电话：40018-40028

网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

**33.恒泰长财证券有限责任公司**

住所：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

办公地址：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

法定代表人：赵培武

联系人：曲志诚

电话：0431-82945299

传真：0431-82946531

客户服务电话：0431-82951765

网址：www.cczq.net

**34.东莞证券有限责任公司**

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：乔芳

电话：0769-22100155

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：www.dgzq.com.cn

**35.华安证券股份有限公司**

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：钱欢

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

客户服务电话：96518(安徽)、4008096518(全国)

网址：www.hazq.com

**36.方正证券股份有限公司**

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址：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：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

### 37.恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：罗俊峰

电 话：0471-4972042

传 真：0471-4961259

客户服务电话：0471-4961259

网 址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

### 38. 联讯证券股份有限公司

住址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

联系人：陈思

电话：021-33606736

传真：021-33606760

客户服务电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

### 39. 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

电话：0755- 82570586

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

网址：www.zszq.com

#### 40. 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

电话：021-64316642

传真：021-54653529

客户服务电话：400-109-9918

网址：www.cfsc.com.cn

#### 41. 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客户服务电话：400 089 1289

网址：www.erichfund.com

#### 42. 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客户服务电话：400 076 6123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

43 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户服务电话：400 678 8887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

44.上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-58870011

传真：021-68596916

客户服务电话：400 700 9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

45.上海天天基金销售有限公司

住所：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：彭远芳

电话：021-54509998-2010

传真：021-64385308

客户服务电话：400 1818 188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

46.北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：宋丽冉

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客户服务电话：400 888 6661

网址：<http://www.myfund.com>

47.中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：赵森

电话：010-59539864

传真：010-59539806

客服电话：95162 或 400 888 8160

网址：[www.cifco.net](http://www.cifco.net)

48.北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：魏争

电话：010-57418829

传真：010-57569671

客服电话：400 678 5095

公司网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

49.深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#



办公地址：北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室

法定代表人：陈操

联系人：刘宝文

电话：010-63130889-8369

传真：010-58325282

客服电话：400-166-1188

网址：[https:// 8.jrj.com.cn](https://8.jrj.com.cn)

#### 50.浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传真：0571-88910240

客服电话：4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（三）份额登记机构：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人：崔伟

联系人：王骁骁

电话：010-66295873

传真：010-66578680

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

（四）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

联系人：吕红

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红 黎明

（五）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅

电话：010-68286868

传真：010-88210608

经办注册会计师：朱锦梅、张静

## 六、基金的募集与基金合同的生效

（一）本基金根据2011年10月20日中国证券监督管理委员会《关于核准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】1687号）和《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2011】860号）的核准，并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

（二）本基金类型：股票型

本基金存续期间：不定期

（三）本基金募集期为：2011年11月21日至2011年12月23日

募集份额为：335,865,199.76份

有效户数为：13,047户

（四）根据《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金备案确认的函》（基金部函【2011】1009号）的批准，本基金基金合同于2011年12月28日生效。

本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

## 七、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

1. 基金管理人的直销机构为直销中心以及电子交易平台。
2. 经基金管理人委托，具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即代销机构销售网点。目前代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“（二）代销机构”。基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。
3. 投资者可通过本基金直销机构或指定的代销机构按照规定的方式进行申购或赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

1. 本基金办理日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日（本基金管理人公告暂停时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9:30-11:30，下午 1:00-3:00。
2. 若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他原因，基金管理人可对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并于实施前在中国证监会指定媒体上公告。
3. 投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回视为下一开放日的交易申请。
4. 本基金自 2012 年 2 月 8 日开始办理申购、赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. 基金采用“金额申购”和“份额赎回”的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按“先进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；
4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
5. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站上予以公告并报中国证监会备案。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请

基金投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，份额登记机构在T+1日内(包括该日)为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购或赎回申请。申购或赎回的确认以份额登记机构的确认结果为准。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过份额登记机构及其相关销售机构在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### （五）申购和赎回的数额限制

1. 投资者每次最低申购金额为1,000.00元(含申购费)，每次定期定额最低申购金额为100.00元，具体办理要求以销售渠道的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于100.00份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足100.00份的，在赎回时需一次全部赎回。

3. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。但基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购费用和赎回费用

##### 1. 申购费用

本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用于本基金的市场推广、销售、注册登记等。投资者选择红利再投资转基金份额时不收取申购费用。

本基金的申购费率如下：

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	1.5%
100 万元以上(含 100 万元)-500 万元以下	1.2%
500 万元以上(含 500 万元)	每笔 1,000.00 元

## 2. 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的 25%归基金资产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

赎回费率如下：

持有期限 (一年按 365 天计算)	赎回费率
1 年以内(不含 1 年)	0.5%
1 年以上-2 年以内(不含 2 年)	0.25%
2 年以上(含 2 年)	0

3. 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

4. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

### (七) 申购份额与赎回金额的计算

#### 1. 基金申购份额的计算：

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

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

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

例 2：某投资者投资 10 万元申购本基金，对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.12 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 100,000 / (1 + 1.5\%) \times 1.5\% = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 1,477.83 = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.12 = 87,966.22 \text{ 份}$$

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，以当日基金份额净值为基准计算，上述涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，舍弃部分归入基金财产；上述涉及金额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 2. 基金赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例 3：某投资者赎回本基金 10 万份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.05 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.05 \times 0.5\% = 525 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 100,000 \times 1.05 - 525 = 104,475 \text{ 元}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，舍弃部分归入基金财产，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 基金份额净值的计算

$$\text{基金份额净值} = \text{基金资产净值总额} / \text{发行在外的基金份额总数}$$

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

## 赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## （八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作；



2. 证券交易所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
4. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告，并报中国证监会备案。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
2. 证券交易所交易时间依法决定非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
4. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
5. 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的赎回；
6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，并报中国证监会备案。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分



顺延赎回。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，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；基金投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3. 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向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。并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体和基金管理人网站上进行公告，并报中国证监会备案。

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### （十二）基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业

务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

### （十三）基金的非交易过户

指基金份额登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经份额登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按基金份额登记机构规定的标准收费。

### （十四）基金的转托管

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

如果出现基金管理人、份额登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

### （十五）定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他代销机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

### （十六）基金的冻结和解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由份额登记机构办理。

基金份额登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及份额登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金份额登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、转出申请、非交易过户以及基金的转托管。

## 八、基金的投资

### （一）投资目标

通过积极主动的投资管理，精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票；努力把握市场趋势，积极进行适当范围内的大类资产配置调整，在严格控制风险的前提下，谋求本基金资产的长期资本增值。

### （二）投资理念

中小盘股票成长预期强、增长空间大，在经济转型下产业结构调整的过程中，成长性确定、基本面良好的中小盘股票将成为经济发展的驱动力，投资于这类股票能够在很大程度上分享新模式下的经济发展成果，结合适当范围内的大类资产配置调整，能够为投资者带来稳定的超额收益。

### （三）投资范围

本基金的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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，股票主要包括基本面良好、具有较高成长性的中小盘股票；债券主要包括具有相对投资价值的国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、短期融资券与可转换债券等固定收益品种。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的股票资产主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股，中小盘股票的投资不低于本基金股票资产的 80%。基金管理人每季度将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并累加，累计流通市值达到 A 股市场总流通市值 2/3 的股票列入中小盘股。基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过 10 个交易日。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停

牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

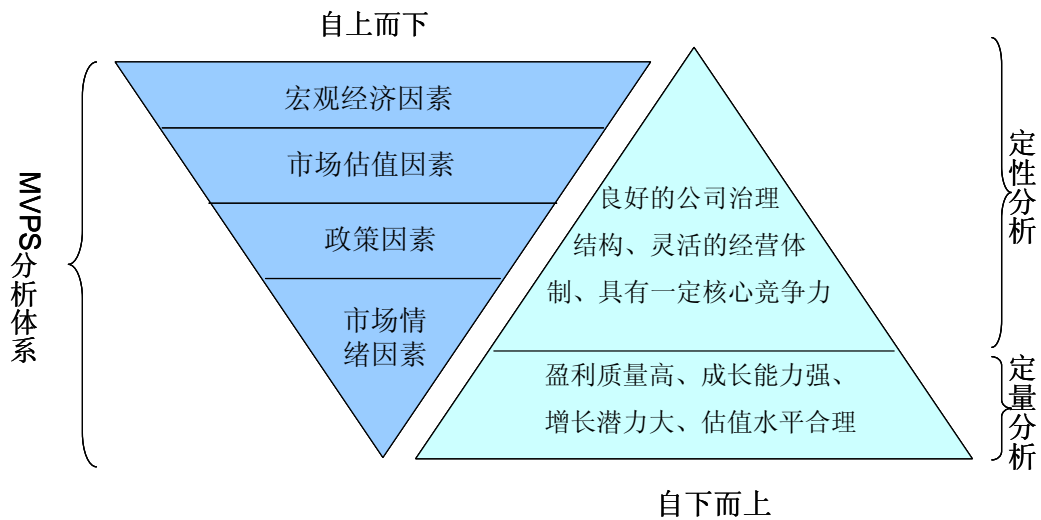
如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

（四）投资策略

本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。

图一-1 投资策略示意图



资料来源：东方基金

1. 大类资产配置

本基金从国际化视野审视中国经济和资本市场，全面分析影响股票市场和债券市场走势的各种因素，深入详细地评估股票市场和债券市场的运行趋势。根据影响证券市场运行的各种因素的变化趋势，及时调整大类资产的配置比例，控制系统性风险。在大类资产配置过程中，本基金主要应用 MVPS 模型，即综合考虑宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等因素的影响来进行大类资产配置。各因素考虑的指标见表一-1。

表一-1 大类资产配置模型指标

因素	指标
宏观经济因素	GDP 增长率及其构成、工业增加值、CPI、PPI 水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2 值及其增加量等
市场估值因素	纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、

	上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等
政策因素	与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策，包括产业发展政策、区域发展政策、货币政策、财政政策、房地产调控政策等
市场情绪因素	新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等

资料来源：东方基金

## 2. 股票投资策略

在个股的选择上，本基金主要采用“自下而上”的方法，挖掘具有持续发展潜力、符合经济转型下产业结构调整方向或国家产业发展政策的、目前股价具有安全边际的中小盘股票作为主要投资对象。通常情况下，这类上市公司股票将占本基金股票总投资的80%以上。

### （1）中小盘股筛选

本基金管理人每季度将对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并累加，累计流通市值达到A股市场总流通市值2/3的股票列入中小盘股。一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时由于股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算其流通市值。

### （2）备选股票池的建立

本基金管理人结合案头分析与上市公司实地调研，对列入研究范畴的股票进行全面系统地分析和评价，建立本基金的备选股票库。定量分析指标见表一-2。

表一-2 备选股票库筛选指标

成长能力强	主营业务收入增长率
	净利润增长率
	经营性现金流量增长率
盈利质量高	总资产报酬率
	净资产收益率
	盈利现金比率
增长潜力大	预测主营业务收入增长率
	预测净利润增长率
估值水平合理	市盈率
	市净率

资料来源：东方基金

#### ①成长能力较强



本基金认为，企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力，因此，本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性，作为判断公司未来成长性的依据。

主营业务收入增长率是考察公司成长性最重要的指标，主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大，体现公司未来盈利潜力的提高，盈利稳定性的加大，公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察上市公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较，并与同行业相比较。

净利润是一个企业经营的最终成果，是衡量企业经营效益的主要指标，净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察上市公司最新报告期的净利润与上年同期的比较，并与同行业相比较。

经营性现金流量反映的是公司的营运能力，体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基金以中小市值公司作为主要投资目标，中小市值公司大都处于成长期，财务风险较大，经营性现金流量在一定程度上反映了公司的盈利质量及财务状况。本基金主要考察上市公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较，并与同行业相比较。

### ②盈利质量较高

本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率(经营现金净流量/净利润)指标来考量公司的盈利能力和质量。

总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标，也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标；净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率，净资产收益率较高且保持增长的公司，能为股东带来较高回报。本基金考察上市公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率，并与同行业平均水平进行比较。

盈利现金比率，即经营现金净流量与净利润的比值，反映公司本期经营活动产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大，一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察上市公司过去两年的盈利现金比率，并与同行业平均水平进行比较。

此外，本基金还将关注上市公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。

### ③未来增长潜力强

公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此，在关注上市公司历史成长性的同时，本基金尤其关注其未来盈利的增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长

率、净利润增长率进行预测，并对其可能性进行判断。

#### ④估值水平合理

本基金将根据上市公司所处的行业，采用市盈率、市净率等估值指标，对上市公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

### （3）核心股票池的建立

本基金按以上标准建立备选股票库后，经过实地调研等，综合考察以下几个方面，构建核心股票池：

#### ①具有良好的公司治理，规范的内部管理

建立良好公司治理结构是公司高效、持续发展的基本保证，是衡量公司管理风险最重要的因素。管理层是否具备清晰的战略目标和有效的执行能力，以及是否具有专业素质和积极进取的执着精神，对公司的长期增长起到至关重要的作用；治理层对公司的战略方向以及管理层履行经营管理责任负有监督责任，治理层是否拥有足够的独立性，并切实履行其指导监督的职责对公司的持久健康发展起到引领作用。因此，股东构成是否合理；董事会的构成及其权利义务是否明晰；公司是否建立了对管理层有效的激励和约束机制；公司是否重视中小股东利益的维护；管理层是否具有良好的诚信度；管理层是否稳定等等对于公司治理结构和内部管理的分析是判断上市公司未来可持续发展能力与潜力的关键。

#### ②高效灵活的经营机制

本基金关注公司管理层对企业的长期发展是否有着明确的方向和清晰的经营思路及对未来经营中或将遇到的风险因素是否有足够的认识和完善的应对措施。公司经营管理的效率如何，是否能够根据市场变化及时调整经营策略；公司的营销机制是否灵活，是否具有较强的市场开拓能力；是否能够灵活利用技术创新、营销管理、成本控制、投融资管理、薪酬体系、战略合作等手段建立企业优势等。

#### ③具备一定竞争壁垒的核心竞争力

本基金将重点观察这类企业是否拥有领先的核心技术，该核心技术是否具备一定的竞争壁垒；是否具备较强的自主研发能力和技术创新能力；未来公司主业的产品线是否存在进一步延伸的可能；是否在所属的细分行业已经拥有较高的市场份额、较为强大的品牌和良好的口碑等。这类企业虽然充分参与市场竞争，但因其具备某一项或某几项核心竞争力的突出优势，能维持业务稳定增长并有能力逐步巩固其行业地位。



④符合经济转型下产业结构调整方向和国家产业发展政策

微观个体经济的发展离不开宏观经济发展环境及发展趋势，在经济结构调整、产业升级的背景下，符合这一潮流的公司将具有更旺盛的生命力和更持久的发展潜力。因此，本基金还将重点关注上市公司的主营业务，是否符合经济结构调整方向；是否受益于国家产业发展政策等。

（4）投资组合的构建与调整

根据上述步骤选择出来的股票完全是通过自下而上的方法得到的结果，可能会导致股票池在单个行业的股票集中度过高，行业配置不够分散，或者组合的行业配置与基准指数的差异过大，造成组合的非系统性风险过高。因此本基金需要根据经济周期、市场形势的变化以及对未来行业发展趋势的判断，对组合的行业配置进行适当的调整，构建投资组合。

①行业配置调整

组合的行业配置调整，由基金经理根据宏观策略研究团队对宏观经济周期、市场运行形势的分析判断，以及行业研究团队对各个行业的行业景气度、行业成长性、行业的盈利能力和行业估值水平等方面所作的分析判断和预测结果来完成。

②组合构建和调整

经过行业配置调整后所确定的股票池，将成为最终可投资的股票池，据此进行实际的股票投资。本基金管理人的风险管理部风险绩效评估小组将定期对投资组合的行业偏离度等各项指标进行评估，作为基金经理调整投资组合的依据之一。

3. 债券投资策略

（1）久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

（2）期限结构策略

在目标久期确定的基础上，本基金将通过债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略，适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等，在短期、中期、长期债券间进行配置，以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变陡时，采取子弹策略；当预期收益率曲线变平时，采取哑铃策略；当预期收益率曲线不变或平行移动时，

采取梯形策略。

### （3）类属资产配置策略

根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，本基金将市场主要细分为一般债券（含国债、央行票据、政策性金融债等）、信用债券（含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等）、附权债券（含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等）三个子市场。在大类资产配置的基础上，本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析，在目标久期控制及期限结构配置基础上，采取积极投资策略，确定类属资产的最优配置比例。

#### ① 一般债券投资策略

在目标久期控制及期限结构配置基础上，对于国债、中央银行票据、政策性金融债，本基金主要通过跨市场套利等策略获取套利收益。同时，由于国债及央行票据具有良好的流动性，能够为基金的流动性提供支持。

#### ② 信用债券投资策略

信用评估策略：信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

回购策略：当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购，将融入的资金投资于信用债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本的套利价值。

#### ③ 附权债券投资策略

本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用BS公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差（OAS）模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

### 4. 权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。

## 5. 资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### （五）投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、风险监控、评估和组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

#### 1. 研究

本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，由研究部负责，采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势、货币政策和财政政策执行情况进行分析，深入研究行业景气状况、市场合理估值水平，预测利率变化趋势；通过对中小市值公司的未来发展潜力的分析，深入研究其合理的投资价值；据此提出大类资产配置、行业配置、个股配置的投资建议。

#### 2. 资产配置决策

投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

基金经理基于研究部的投资建议，根据自己对未来一段时期内证券市场走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和行业配置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

#### 3. 组合构建

大类资产配置比例范围确定后，基金经理参考研究员的个股投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

#### 4. 交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

#### 5. 风险监控

本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

#### 6. 风险绩效评估

风险管理部风险绩效评估小组定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

## 7. 组合调整

基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程进行调整。

### （六）投资限制

#### 1. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、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债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### 2. 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）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）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- （3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的

40%;

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(5) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(6) 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%；

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

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

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起三个月内全部卖出；

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

(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；

(13) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

(14) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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

(七) 业绩比较基准

本基金采用“中证 700 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%”作为投资业绩比较



基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数或债券指数时，本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

#### （八）风险收益特征

本基金为混合型基金，股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票，属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益。

#### （十）基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

#### （十一）基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的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至 2014 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

##### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	81,703,924.41	75.07
	其中：股票	81,703,924.41	75.07
2	固定收益投资	23,906,440.00	21.97

	其中：债券	23,906,440.00	21.97
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,602,999.16	2.39
7	其他资产	623,242.09	0.57
8	合计	108,836,605.66	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,125,000.00	1.05
C	制造业	39,663,943.87	36.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,073,500.00	2.86
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,161,199.42	23.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,394,481.12	4.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,433,000.00	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,502,800.00	4.18
R	文化、体育和娱乐业	2,350,000.00	2.18
S	综合	-	-
	合计	81,703,924.41	75.92

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	210,000	8,857,800.00	8.23
2	300024	机器人	180,000	6,444,000.00	5.99
3	300170	汉得信息	400,000	5,968,000.00	5.55
4	300124	汇川技术	169,561	5,102,090.49	4.74
5	002421	达实智能	150,000	4,755,000.00	4.42



6	300012	华测检测	219,944	4,394,481.12	4.08
7	000915	山大华特	149,975	4,304,282.50	4.00
8	600372	中航电子	149,828	4,009,397.28	3.73
9	300252	金信诺	100,000	3,532,000.00	3.28
10	300015	爱尔眼科	120,000	3,139,200.00	2.92

4. 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,005,500.00	4.65
	其中：政策性金融债	5,005,500.00	4.65
4	企业债券	2,462,000.00	2.29
5	企业短期融资券	10,965,340.00	10.19
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,473,600.00	5.09
8	其他	-	-
9	合计	23,906,440.00	22.21

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	041462035	14华映科技CP002	59,000	5,915,340.00	5.50
2	113003	重工转债	40,000	5,473,600.00	5.09
3	041456004	14美克CP001	50,000	5,050,000.00	4.69
4	140444	14农发44	50,000	5,005,500.00	4.65
5	112165	12德豪债	25,000	2,462,000.00	2.29

6. 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1). 本基金所持有的金信诺（300252）于2014年3月6日对外公告了被处罚的事宜。深圳金信诺高新技术股份有限公司董事会于2014年3月6日发布了《深圳金信诺高新技术股份有限公司关于收到《行政监管措施决定书》的公告》。公告称，2014年3月5日，深圳金信诺高新技术股份有限公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局下发的《关于对深圳金信诺高新技术股份有限公司采取责令改正措施的决定（【2014】4号）》，中国证监会决定向深圳金信诺高新技术股份有限公司下发责令改正决定书，责令该公司按要求采取有效措施进行整改。

本基金决策依据及投资程序：

①研究部对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

②投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

③基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

④交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

⑤投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资金信诺主要基于以下原因：基本面上看，公司半柔电缆（基站天线内部连接）、半钢电缆和低损电缆（微波通信式基站回传）、轧纹电缆（基站的馈线系统）、柔性电缆及连接器（机柜内的连接）等通信线缆产品进入华为、爱立信等全球前4大设备厂商，公司未来2~3年在全球和我国4G建设带动下产品需求爆发确定性高；军品方面，公司军标系列电缆和稳相电缆可用于空军飞机（战斗机、预警机、直升机等）和海军舰载的通信系统，符合我国未来5~10年加快军事信息化进程的趋势。相关处罚不影响公司的核心竞争力，同时也有利于公司改善其治理结构；与同行业公司比较，公司竞争优势也比较突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了上述投资程序。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调

查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2). 本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3). 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	96,559.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	300,281.15
5	应收申购款	213,799.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	12,601.78
8	其他	-
9	合计	623,242.09

(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	113003	重工转债	5,473,600.00	5.09

(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。

## 九、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

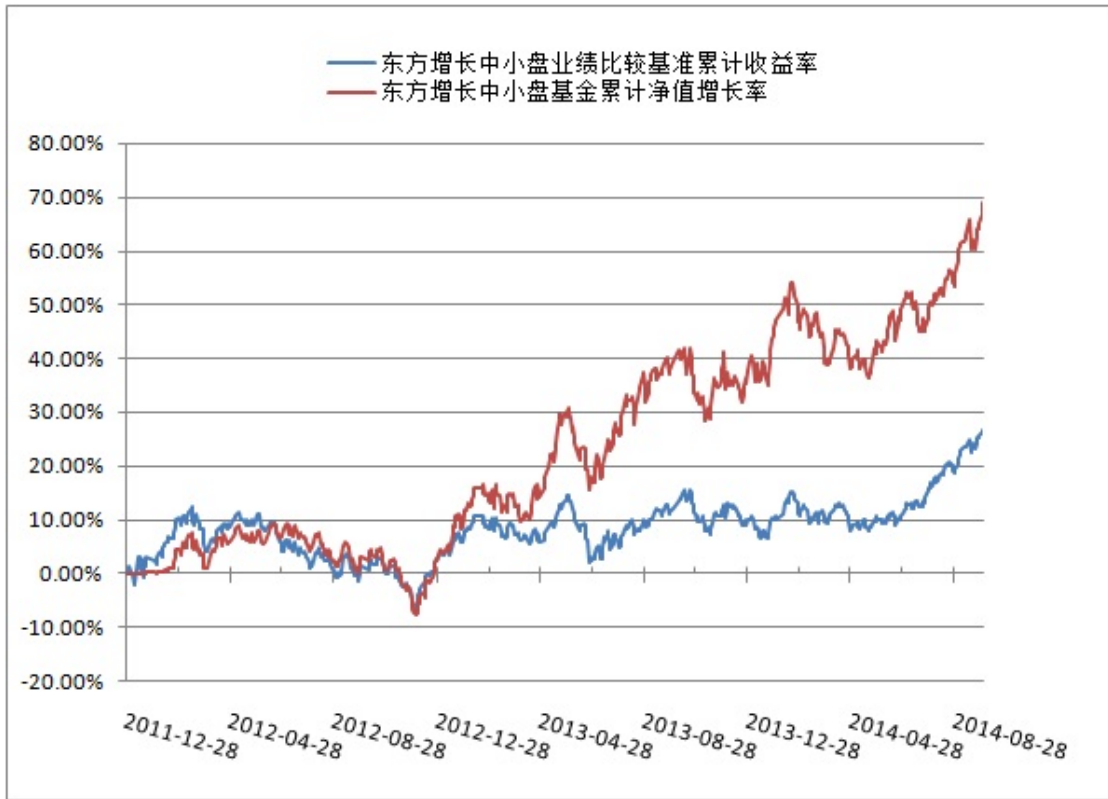
(一) 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2011/12/28-2011/12/31	0.03%	0.01%	1.06%	0.58%	-1.03%	-0.57%
2012/1/1-2012/12/31	4.52%	0.85%	2.63%	0.89%	1.89%	-0.04%
2013/1/1-2013/12/31	33.76%	1.26%	6.36%	0.85%	27.40%	0.41%

2014/1/1-2014/6/30	7.82%	1.08%	1.15%	0.71%	6.67%	0.37%
2014/7/1-2014/9/30	11.92%	0.89%	13.34%	0.55%	-1.42%	0.34%

（二）本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①根据《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%–80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%–70%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。

②本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。本基金合同生效日为 2011 年 12 月 28 日，截至 2014 年 9 月 30 日，本基金成立不满三年。

③所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 十、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

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

## 十一、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供

计价依据。

## （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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交易日。

## （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

## （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

### 1. 股票估值方法

#### （1）上市流通股票的估值

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值

① 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

② 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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

③ 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

#### ④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
 (FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初



始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3. 权证估值方法：

（1）配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

（2）认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最



近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4. 本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5. 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6. 在任何情况下，基金管理人如采用上述估值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，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场各因素的基础上，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。

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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

#### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人应于每个工作日对基金资产完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间、程序复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或份额登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差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无法预见、无法避免、无法抗拒，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者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

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

(2) 差错的责任方对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，如果因基金管理人的行为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，如果因基金托管人的行为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；

(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有责任的当事人进行追索，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。

## 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金份额登记机构的交易数据的，由基金份额登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

#### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通知基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金基金份额净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通知基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任；

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任；

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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

现该错误而造成的基金份额净值计算错误，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的措施消除由此造成的影响。

（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者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （七）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；
4. 出现基金管理人认为属于紧急事故的情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；
5. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （九）特殊情形的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2. 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，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的措施消除由此造成的影响。

## 十二、基金收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2. 每一基金份额享有同等分配权；

3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；

4. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配6次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

5. 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

6. 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

7. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配



时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

1. 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，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2. 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（六）基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，份额登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金合同生效后的信息披露费用；
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金的证券交易费用；
7. 基金财产拨划支付的银行费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。管理费的计算方法

如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%

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

基金管理费每日计提，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首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

## 2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

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，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—7 项费用，由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（五）基金合同生效后运作前产生的相关费用由管理人垫付，运作后由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### （六）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于



新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

#### （七）基金税收

基金运作过程中涉及的各项纳税主体根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金管理人为本基金的基金会计责任方；
2. 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
3. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 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；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
3. 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。基金管理人应当依据有关规定在指定媒体上公告。

## 十五、基金的信息披露

（一）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。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1. 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媒体和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每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和基金管理人网站上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面

说明。

(2) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

## 2. 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媒体和基金管理人网站上。

## 3. 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媒体和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

## 4. 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款规定的市场交易日的次日，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媒体和基金管理人网站上。

## 5. 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 2 日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 6. 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 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

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

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

#### 7. 临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (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百分之三十；
- (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百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；

- (19) 基金变更、增加或减少销售代理机构；
- (20) 更换基金份额登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金暂停接受申购、赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；
- (26) 基金推出新业务或服务；
- (27) 中国证监会规定的其他事项。

#### 8. 澄清公告

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

#### 9. 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

#### 10. 中国证监会规定的其他信息。

##### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披

露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

## 十六、风险提示

一般来讲，预期投资收益越高，所伴随的风险越大。本基金属于混合型基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金所面临的风险主要包括以下部分：

#### （一）系统性风险：

系统性风险是指由于经济、政治、环境等因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括利率风险、政策风险、经济周期风险、购买力风险等。

1. 利率风险：对于股票投资而言，利率的变化将导致证券市场资金供求状况、上市公司的融资成本和利润水平等发生变化，同时改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期，这将直接影响证券价格发生变化，进而影响本基金的收益水平。对于债券投资而言，利率的变化不仅会影响债券的价格及投资者对于后市的预期，而且会带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

2. 政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

3. 经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。证券市场对于宏观经济运行状况的直接反应将影响本基金的收益水平。

4. 购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

#### （二）非系统性风险：



非系统性风险是指个别行业或个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

1. 经营风险：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。

2. 信用风险：指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的基金资产损失的风险。

#### （三）流动性风险：

流动性风险主要包括以下两个方面：一方面是指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、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

#### （四）运作风险：

1. 管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于公司内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

2. 交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

3. 运作风险：由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

4. 道德风险：指业务人员道德行为违规产生的风险，包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险；

#### （五）特定风险：

本基金为中小盘混合型基金，以对中小市值股票的投资为主。由于很多中小市值的上市公司处于初创期或成长期，其市场地位不稳固，财务状况和抗风险能力不强，相对于成熟期的公司而言，其经营风险大，相应地，中小盘股票的价格具有高波动性的特点。因此可能会导致本基金净值的波动率高于其他类型的混合型基金或市场平均水平。

#### （六）法律风险：

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （七）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。



## 十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1. 下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会，并经基金份额持有人大会决议同意：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- （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）基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系；
- （5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效，基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；
3. 基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；
4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组：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、基金份额登记机构、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. 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

### 5. 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财产；
  - （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
  - （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
  - （4）对基金财产进行估值和变现；
  - （5）基金清算组做出清算报告；
  - （6）会计师事务所对清算报告进行审计，
  - （7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - （8）将基金清算结果报告中国证监会；
  - （9）公布基金清算公告；
  - （10）对基金剩余财产进行分配；
6. 基金财产清算的期限为6个月。

### （四）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。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

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

基金财产未按前款 1—3 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（六）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；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公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十八、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1. 基金份额持有人的权利

基金投资者自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （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、基金份额代销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

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

(2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 3. 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(3) 依照有关规定为基金的利益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和基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 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；

(7) 自行担任基金份额登记机构或选择、更换份额登记机构，并对份额登记机构的代理行为

进行必要的监督和检查；

(8) 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；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

#### 4. 基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

(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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，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小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 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；
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (27) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 5. 基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (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) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；



- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册；
- (8) 法律法规规定的其他权利。

## 6. 基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，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；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有



人大会：

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 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；

(21) 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和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

(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

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

① 终止基金合同；

② 转换基金运作方式；

③ 变更基金类别；

④ 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

⑤ 变更基金份额持有人大会程序；

⑥ 更换基金管理人、基金托管人；

⑦ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

⑧ 本基金与其他基金的合并；

⑨ 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

⑩ 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%，下同)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)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

⑪ 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

⑫ 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- ②在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- 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；
- ⑤基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- ⑥按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人及召集方式

（1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- ①会议召开的时间、地点；
- ②会议拟审议的主要事项；
- ③会议形式；
- ④议事程序；
- ⑤有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- ⑥授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- ⑦表决方式；
- ⑧会务常设联系人姓名、电话；
- ⑨出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- ⑩召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

## 5. 基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

- ①基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- ②现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
- ③通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

### ④会议的召开方式由召集人确定。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### <1>现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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

#### 〈2〉通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

2) 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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与份额登记机构记录相符；

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

### 6. 议事内容与程序

#### (1) 议事内容及提案权

① 议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、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。

② 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召

开日前 35 日提交召集人并由召集人公告。

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。

③召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于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。

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

④单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

⑤基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

## （2）议事程序

### ①现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份



证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## ②通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### ① 一般决议

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

### ②特别决议

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

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 8. 计票

### (1) 现场开会

①如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。



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

③如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议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，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

④计票过程应由公证机关予以公证。

#### （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，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。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

#### 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

#### 10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

##### （三）基金收益分配原则、执行方式

##### 1. 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

##### 2. 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 3. 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；

（4）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配6次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

（5）基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

（6）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（7）基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

（8）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

### 4. 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 5. 收益分配方案的确定、公告与实施

（1）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，基金管理人按法律

法规的规定公告并向中国证监会备案。

(2) 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

(3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6. 收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，份额登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

(四) 与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

##### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

##### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

(五) 基金财产的投资范围和投资限制

##### 1. 投资范围

本基金的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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，股票主要包括基本面良好、具有较高成长性的中小盘股票；债券主要包括具有相对投资价值的国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、短期融资券与可转换债券等固定收益品种。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%–80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%–70%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的股票资产主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股，中小盘股票的投资不低于本基金股票资产的 80%。基金管理人每季度将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并累加，累计流通市值达到 A 股市场总流通市值 2/3 的股票列入中小盘股。基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过 10 个交易日。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

## 2. 投资限制

### （1）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- ①承销证券；
- ②向他人贷款或提供担保；
- ③从事承担无限责任的投资；

- ④ 买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- ⑤ 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- ⑥ 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- ⑧ 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## （2）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- ① 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 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%；
- ③ 本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- ④ 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- ⑤ 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- ⑥ 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%；
- ⑦ 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- ⑧ 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- ⑨ 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- ⑩ 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起三个月内全部卖出；
- ⑪ 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数



量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑫ 本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家  
公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；

⑬ 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

⑭ 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合  
不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。  
法律法规另有规定的从其规定。

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

#### （六）基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

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  
管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净  
值登载在指定媒体。

#### （七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

##### 1. 基金合同的变更

（1）下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大  
会决议同意：

- ① 终止基金合同；
- ② 转换基金运作方式；
- ③ 变更基金类别；
- ④ 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- ⑤ 变更基金份额持有人大会程序；



- ⑥更换基金管理人、基金托管人；
- ⑦提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- ⑧本基金与其他基金的合并；
- ⑨对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- ⑩法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- 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调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- 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基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；
- ⑤基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- ⑥按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

## 2. 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；
- (3) 基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 3. 基金财产的清算

### (1) 基金财产清算小组

①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基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、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用必要的工作人员。

③在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

④基金清算小组负责基金财产的保管、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。

（2）基金财产清算程序：

- ①基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ②基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④对基金财产进行评估和变现；
- ⑤基金清算组做出清算报告；
- ⑥会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑦律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧将基金清算结果报告中国证监会；
- ⑨公布基金清算公告；
- ⑩对基金剩余财产进行分配。

（3）基金财产清算的期限为6个月。

（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）基金财产按如下顺序进行清偿：

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

基金财产未按前款①—③项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（6）基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；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公告。

（七）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

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（九）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和份额登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1. 基金管理人

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立日期：2004 年 6 月 11 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元

存续期间：50年

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

## 2. 基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：邮储银行）

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

邮政编码：100808

法定代表人：李国华

成立日期：2007年3月6日

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币450亿元

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；办理票据承兑和贴现；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；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金管理人及基金托管人之间的业务监督、核查

#### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督和复核

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。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。

本基金的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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，股票主要包括基本面良好、具有较高成长性的中小盘股票；债券主要包括具有相对投资价值的国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、短期融资券与可转换债券等固定收益品种。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%–80%，其中投资于中小盘股

的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，本基金在履行相关程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

基金托管人严格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，基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资范围、投资对象造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。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本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- ③本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- ④本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- ⑤现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- ⑥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%；
- ⑦本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- ⑧本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- ⑨本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- ⑩本基金应投资于信用级别评级为 BBB 级以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有资产

支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起三个月内全部卖出；

①本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

②本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的10%；本基金持有一家发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的5%；

③本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

④相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。

如果法律法规对基金合同约定的组合限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，履行适当程序后，本基金投资不再受上述规定限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。基金托管人严格依照监督程序对基金投资、融资、融券比例进行监督，基金托管人尽职履行监督义务后，基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资、融资、融券比例限制造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

(3)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定对下述基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及基金合同的约定，基金财产不得用于下列投资或者活动：

①承销证券；

②向他人贷款或提供担保；

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向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；



⑥买卖与本基金基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

⑦从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑧依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

基金托管人履行了监督职责，基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资禁止行为而造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

（4）基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行向基金管理人电话确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

（5）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。

①基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

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，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话确认收到该名单。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，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前2个工作日内与基金托管人确认，基金托管人于1个工作日内向基金管理人电话确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人撤销交易，基金管理人仍不撤销的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规定的除外。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任，但有权报告中国证监会，法律法规另有规定的除外。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式。基金管理人仍不重新确定交易方式的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规定的除外。

(6) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

①基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

②基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明

确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

③基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

④基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失，基金托管人不承担任何责任。

(7) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

①基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

②流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

③在投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应根据本基金的投资风格和流动性的需要，合理控制基金投资非公开发行证券等流通受限证券的比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免出现流动性风险。投资流程及风险控制制度需经董事会授权，其中投资非公开发行股票，基金管理人董事会还应批准相关流动性风险处置预案，一旦因投资非公开发行股票出现流动性风险，由基金管理人承担该风险，具体规定依据相关法律法规执行。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

④基金管理人管理的基金在投资流通受限证券前，应按照审慎的风险控制原则，向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的资格证明、发行证券数量、定价依据、募集资金投向、承销商、发行期限、流通受限期限，管理人管理的基金拟认购

的数量、价格、占基金资产净值的比例、划付账号、划付款项、划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并至少于拟执行投资指令的前两日将上述信息书面发至托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人如对基金管理人的投资运作存在疑义，基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，并就基金托管人的疑义进行解释或举证，如投资运作行为违反相关规定的，基金管理人应及时改正或补救。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(6) 基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。如果基金托管人切实履行了监督职责，则不承担任何责任。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(8) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提示或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内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在上述规定期限内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(9) 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。

(10) 基金托管人发现基金管理人存在重大违法、违规行为，应及时报告中国证监会，同时通



知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据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，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 2. 基金管理人 对基金托管人的业务核查

(1) 基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、及时、准确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且如遇到问题应及时反馈、相关信息披露和监督基金投资运作是否对非公开信息保密等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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。

(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在下一工作日前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，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。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等。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，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。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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### (三) 基金财产的保管

#### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

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

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定保管基金财产。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、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，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## 2. 基金募集期间及募集资金的验资

(1) 本基金募集期届满之日前，投资者的认购款项只能存入基金管理人在托管银行开立的“基金募集账户”，本账户由基金管理人保管，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以份额登记机构的记录为准。

(2) 基金募集期满或基金提前结束募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件，基金管理人在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户，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。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) 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。

(4) 基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5) 在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金银行账户办理基金资产的支付。

#### 4. 基金证券交收账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

(3) 基金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,以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金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) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开设、使用的,按有关规定开设、使用并管理;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。

#### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,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报中国人民银行备案,并代表基金进行银行间市场债券的结算。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,协议正本由基金托管人保管,协议副本由基金管理人保存。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易,由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

#### 6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,在基金管理人和基金托管人商议后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。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对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。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管，相关业务程序另有限制除外。除协议另有规定外，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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 10 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### （四）基金资产净值计算和会计核算

#### 1. 基金资产净值的计算及复核程序

##### （1）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

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

##### （2）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

予以公布。

## 2. 基金资产估值方法和特殊情形的处理

### （1）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （2）估值方法

#### 〈1〉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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### 2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

#### ④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$
（FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

<2> 债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

<3> 权证估值方法：

1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

<4>本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

<5>本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

<6>在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### （3）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按第2条第<6>款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，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、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。

## 3. 估值错误的处理方式

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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### （1）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或份额登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差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者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## （2）差错处理原则

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

②差错的责任方对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，如果因基金管理人的行为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，如果因基金托管人的行为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；

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有责任的当事人进行追索，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。

## （3）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：



- ①查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- ②根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- ③根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- ④根据差错处理的方法，需要修改基金份额登记机构交易数据的，由基金份额登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### （4）基金份额净值差错处理的原则和方法

<1>当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通知基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通知基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

<2>当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任；

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任；

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任。

<3>由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，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的措施消除由此造成的影响。

〈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者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4. 暂停估值与公告基金份额净值的情形

- （1）与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；
- （4）出现基金管理人认为属于紧急事故的情况，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。

#### 5. 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6. 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### 7. 基金财务报表与报告的编制和复核

##### （1）财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕

并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

## （2）报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

8. 基金管理人应每周向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## （五）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由份额登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于

发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （六）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### （七）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1. 托管协议的变更程序

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

##### 2. 基金托管协议终止的情形

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

##### 3. 基金财产的清算

- （1）基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。
- （2）基金财产清算组

①自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

②基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的

工作人员。

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

#### （3）清算程序

- ①基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ②基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④对基金财产进行评估和变现；
- ⑤基金清算组做出清算报告；
- ⑥会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑦律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧将基金清算结果报告中国证监会；
- ⑨公布基金清算公告；
- ⑩对基金剩余财产进行分配。

#### （4）清算费用

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

#### （5）基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- ①支付基金财产清算费用；
- ②缴纳基金所欠税款；
- ③清偿基金债务；
- ④清算后如有余额，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

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；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公告。

- （7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。



## 二十、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）开户确认

基金管理人为投资者提供开户网上查询确认服务，投资者可通过登陆公司网站了解相关的开户信息。

### （二）资料发送

#### 1. 基金投资人对账单

基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单定期发送服务，并为有需要的投资者提供纸质对账单的寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息，基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过公司网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息，我们将按投资者的选择定期为其发送电子对账单。

#### 2. 其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别，寄送公司期刊及各类研究报告，动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### （三）呼叫中心服务

东方基金呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询，在这过程中客户有任何需要帮助的地方，均可以转接人工或在语音信箱中留言；系统同时受理 E-Mail 等多样化咨询方式，为客户提供便捷多样的交流方式。

### （四）网上交易业务

本基金已开通网上交易业务，个人投资者可通过本公司网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务，本公司在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动，个人投资者通过本公司网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠，详情可登陆本公司网站 [www.df5888.com](http://www.df5888.com) 及或 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 查阅本公司旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。



#### （五）网上查询服务

通过本公司网站，客户还可获得如下服务：

##### 1. 查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

##### 2. 信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

#### （六）资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打本公司如下电话：

电话呼叫中心：400-628-5888，该电话可转人工座席。

传真：010-66578700

#### （七）定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他代销机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

#### （八）基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

#### （九）客户投诉受理服务

投资者可以通过客户服务热线（400-628-5888）、公司网站（www.df5888.com 或 www.orient-fund.com）、电子邮件（services@orient-fund.com）、传真、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见，并按照“客户投诉和建议”流程处理，在规定的时间内予以反馈。

#### （十）投资顾问服务

本公司拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队，分布于北京、上海等地区，致力于为客户提供优异的个性化理财服务。

公司网址：[http:// www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [http:// www.df5888.com](http://www.df5888.com)

电子信箱：services@orient-fund.com

## 二十一、其他应披露事项

（一）在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

（二）基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定（包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充）。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了本基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成协议。

（三）本招募说明书将按中国证监会有关规定定期进行更新；招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

（四）从上次《招募说明书（更新）》截止日2014年6月28日至本次《招募说明书（更新）》截止日2014年12月28日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金半年度最后一日净值公告</a>	2014-07-01
<a href="#">关于增加联讯证券为旗下基金销售渠道的公告</a>	2014-07-15
<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金2014年第2季度报告</a>	2014-07-18
东方基金管理有限责任公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼任职务等情况的公告	2014-07-19
关于增加中山证券为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2014-07-29
关于增加中国国际期货为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2014-08-07
关于增加钱景财富为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2014-08-08
<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）（2014年第1号）</a>	2014-08-11
东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2014年第1号）	2014-08-11
<a href="#">关于增加深圳新兰德为旗下基金销售渠道并参与其费率优惠活动的公告</a>	2014-08-26

<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年半年度报告</a>	2014-08-28
<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年半年度报告摘要</a>	2014-08-28
关于增加浙江同花顺为旗下基金销售渠道并开通定投、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2014-09-02
关于增加华鑫证券为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2014-09-12
<a href="#">关于旗下基金继续参与五矿证券基金申购费率优惠活动的公告</a>	2014-10-14
<a href="#">东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年第 3 季度报告</a>	2014-10-27
<a href="#">东方基金管理有限责任公司关于参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告</a>	2014-11-10
<a href="#">东方基金管理有限责任公司关于参加数米基金费率优惠活动的公告</a>	2014-12-23
<a href="#">关于在申银万国证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告</a>	2014-12-26

## 二十二、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的办公地址，供公众查阅、复制。

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。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(www.df5888.com 或 www.orient-fund.com)查阅和下载招募说明书。

## 二十三、备查文件

以下备查文件分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

- 一、中国证监会批准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的文件
- 二、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 三、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》
- 四、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金法律意见书》
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照

东方基金管理有限责任公司

2015年2月10日