

## 华宝兴业动力组合股票型证券投资基金更新的招募说明书

2006年6月

### 【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于同意华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005]162号)和《关于华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集时间的函》(基金部函[2005]240号)的核准,进行募集。基金合同于2005年11月17日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业动力组合股票型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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书所载内容截止日为2006年5月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年3月31日,财务数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的,以本次更新的招募说明书为准。

## 目录

一、绪言	1
二、释义	2
三、基金管理人	6
四、基金托管人	12
五、相关服务机构	17
六、基金的募集	22
七、基金合同生效	23
八、基金份额的申购与赎回	24
九、与基金管理人管理的其他基金转换	31
十、基金的投资	32
十一、基金的业绩	39
十二、基金财产	40
十三、基金资产估值	41
十四、基金收益与分配	45
十五、基金的费用	46
十六、基金税收	48
十七、基金的会计与审计	49
十八、基金的信息披露	50
十九、风险揭示	53
二十一、基金合同的内容摘要	58
二十二、基金托管协议内容摘要	70
二十三、对基金份额持有人的服务	77
二十四、其他应披露事项	79
二十五、招募说明书存放及查阅方式	80
二十六、备查文件	81

## 一、 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、其他有关规定及《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业动力组合股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。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出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 招募说明书：指《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日；
- 基金或本基金：指华宝兴业动力组合股票型证券投资基金；
- 基金合同：指《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》及其任何有效的修订和补充；
- 份额发售公告：指《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金份额发售公告》；
- 《证券法》：指《中华人民共和国证券法》；
- 《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》；
- 《运作办法》：指《证券投资基金运作管理办法》；
- 《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》；
- 《信息披露办法》：指《证券投资基金信息披露管理办法》；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；
- 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
- 基金管理人或本基金管理人：指华宝兴业基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司或接受华宝兴业基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
销售机构：	指直销机构及代销机构；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点；
基金份额持有人：	指根据基金合同合法取得本基金基金份额的个人投资者、机构投资者和合格的境外机构投资者；
个人投资者：	指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及其他可以投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记并存续或经有权政府部门批准设立并存续、依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格的境外机构投资者：	指符合国家有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的境外机构；
投资人或基金投资人：	指个人投资者、机构投资者和合格的境外机构投资者的合称；
基金合同生效日：	指 2005 年 11 月 17 日；
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；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；
T 日：	指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务有效申请的日期；
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)；
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；
认购：	指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购

- 买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指基金份额持有人按本基金合同规定的条件，投资人申请卖出本基金基金份额的行为；
- 基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
- 转托管：指基金份额持有人将其所持有的某一基金份额从同一个基金账户下的一个交易账号指定到另一交易账号进行交易的行为；
- 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、基金的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
- 基金资产总值：指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他投资所形成的基金财产的价值总和；
- 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金资产估值：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；
- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体；
- 元：指人民币币值单位元；
- 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章以及其他对合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；
- 不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免且在基金合同由基金管理人、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协议的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发

事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

办公地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

法定代表人：郑安国

总经理：裴长江

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1 亿元

电话：021 - 50499588

联系人：林志宗

股权结构：中方股东华宝信托投资有限责任公司持有 67%的股份，外方股东法国兴业资产管理有限公司持有 33%的股份。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

郑安国先生，董事长、博士、高级经济师。历任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理。

Christian D'ALLEST 先生，董事，法学硕士。曾任法国兴业银行国际部业务经理、国际融资司经理、资本市场司负责人、资产管理司负责人。现任法国兴业资产管理有限公司国际部主任。

王晓薇女士，董事，本科。曾任宝钢国际贸易有限公司财务部业务经理、宝钢美洲贸易有限公司财务经理。现任华宝信托投资有限责任公司副总经理。

袁志刚先生，独立董事，博士、教授、博导。法国巴黎社会科学高等研究院(E. H. E. S. S.)经济学博士毕业，曾任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。现任复旦大学经济学院院长。

Christian CLERC-BATUT 先生，独立董事，商学本科。曾任 S. N. S. 阿尔及利亚子公司总会计师、欧尚集团存货部总监、芝加哥子公司总经理、审计部总审计师。现任欧尚集团



中国及泰国区总经理。

谢荣先生，独立董事，博士、教授。曾任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授，毕马威华振会计师事务所合伙人。现任上海国家会计学院副院长。

吴志攀先生，独立董事，法学博士、教授。曾任北京大学法律系讲师、副教授、教授、博导，经济法教研室副主任、系主任，北京大学法学院院长，北京大学校长助理。现任北京大学副校长。

裴长江先生，董事总经理，硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理，申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理，申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

陆云飞（Denis LEFRANC）先生，董事副总经理，文学士，法学士。曾任法国期货市场委员会审计员，法国兴业银行法律顾问，法国兴业银行资本市场及资产管理部副经理，BAREP 资产管理公司（法国兴业银行集团子公司）首席法律顾问，法国兴业资产管理有限公司首席法律顾问。现任华宝兴业基金管理有限公司董事副总经理。

Albert Reculeau先生，监事、监事会召集人，BP Bank银行专业学位。曾任法兴资产亚太区首席执行官；现任IBK-SG Asset Management（法兴资产韩国）首席执行官。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任公司营运副总监。

詹靖女士，监事，金融学硕士，曾在TCL销售公司人力资源部、华宝信托投资有限责任公司业务管理部、基金筹备组、华宝兴业基金管理有限公司投资管理部工作，现在公司人力资源部工作。

## 2、本基金基金经理

史伟先生，英国雷丁大学国际证券业协会中心硕士。曾在东方证券投资部任职。2003年初加入华宝兴业基金管理有限公司，任分析师、高级分析师，2005年1月起任华宝兴业宝康消费品基金基金经理助理。

## 3、投资决策委员会成员

裴长江先生，公司总经理。

陆云飞（Denis LEFRANC）先生，公司副总经理。

余荣权先生，投资总监、多策略增长基金基金经理。

栾杰先生，投资副总监、投资部总经理、宝康消费品基金基金经理。

魏东先生，宝康灵活配置基金基金经理。

王旭巍先生，宝康债券基金基金经理、现金宝货币市场基金基金经理。

### (三) 基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 1、 依法募集本基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、 办理本基金备案手续；
- 3、 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；
- 4、 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；
- 5、 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、 编制中期和年度基金报告；
- 7、 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、 召集基金份额持有人大会；
- 10、 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；
- 11、 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；
- 12、 中国证监会规定的其他职责。

### (四) 基金管理人承诺

1、 基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发

2、 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 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；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、 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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

(4) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人内部控制制度

##### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

##### 2、内部控制制度

###### (1) 内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透

到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

**有效性原则。**通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，保证内部控制制度的有效执行。

**独立性原则。**公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行。

**相互制约原则。**内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

**防火墙原则。**公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场开发等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

**成本效益原则。**公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

**合法合规性原则。**公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

**全面性原则。**内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞。

**审慎性原则。**公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

**适时性原则。**内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

## （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

## （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，经董事会聘任或者解聘。督察长的任免须

报中国证监会核准。

公司督察长可列席公司相关会议，对基金运作、内部管理等方面及遵守法规情况进行内部监察、稽核，定期独立出具稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

#### （4）内控审计风险管理制度

内控审计风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

内控审计风险管理部负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；协助评价基金财产风险状况；负责公司主要领导离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

### 3、基金管理人关于内部合规控制声明书

- （1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- （2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 四、 基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

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

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元

存续期间：持续经营

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门总经理：秦立儒

托管部门联系人：宁敏

电话：(010) 66594977

传真：(010) 66594942

发展概况：

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险业务领域，并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务。在近百年的岁月里，中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖，打造了卓越的品牌，与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务，包括公司业务和零售业务等业务。公司业务以授信产品为基础，向客户提供包括存款、结算、清算、资金、托管等在内的各项金融产品和融资、财务解决方案。零售业务以个人及小企业法人为主要服务对象，为客户提供包括储蓄存款、消费信贷、银行卡、个人理财、汇款等在内的各项金融服务。在多年的发展历程中，中国银行曾创造了中国银行业的许多第一，所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河，在业界独领风骚，享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域仍居领先地位。中国银行网络机构覆盖全球27个国家和地区，中国银行机构总数11,910个，其中境内机构共计11,307个，境外机构共计603个，是目前我国国际化程度最高的商业银行。

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史，在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立，至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间，中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。中国银行以诚信为本，以振兴民族金融业为己任，在艰难和战乱的环境中拓展市场，稳健经营，锐意改革，表现出了顽强的创业精神，银行业务和经营业绩长期处于同业领先地位，并将分支机构一直拓展到海外，在中国近现代银行史上留下了光辉的篇章。

1949 年，中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行，为国家经济建设和社会发展作出了巨大贡献。1994 年随着金融体制改革的深化，中国银行成为国有商业银行，与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年，中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。

为提高竞争优势，中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年，中国银行成功重组了香港中银集团，将 10 家成员银行合并成当地注册的“中国银行（香港）有限公司”。2002 年 7 月，重组后的中国银行（香港）有限公司在香港联交所成功上市，成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

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

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

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。曾先后 9 次被《欧洲货币》评选为“中国最佳银行”；连续 16 年进入《财富》杂志评选的世界 500 强企业；在全球新兴市场 250 大银行按所有者权益进行的排名中名列第一，在亚洲《银行家》杂志 300 大银行按所有者权益排名第二，是中国资本最雄厚的商业银行。同时，先后被《欧洲货币》和《资产》评为“中国最佳银行”和“中国国内最佳银行”；被美国《环球金融》杂志评为“2004 年中国最佳贸易融资银行”、“2004 年中国最佳外汇银行”、“中国最佳银行”及“亚洲最佳项目融资银行”；被香港《亚洲货币》杂志评为“中国最佳现金管理业务银行”及“中国最佳外汇业务银行”；被《亚洲风险》杂志评为“中国内地最佳金融风险管理奖”；被 MasterCard 国际组织评为“2004 年最佳双币卡奖”、“2004 年亚太区最佳联名

卡(万科)奖”及“2004年最佳国际卡发卡奖”；被Visa国际组织评为“2004年最佳奥运卡拓展奖”；中银香港重组上市后，先后荣获《投资者关系》“最佳IPO投资者关系奖”和《亚洲金融》“最佳交易、最佳私有化奖”等多个重要奖项。

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

#### 财务概况：

2004年中国银行集团实现营业利润578亿元，净利润209亿元。剔除2003年出售中银香港部分股份获得净投资收益的影响，集团2004年营业利润比2003年增长21.3%。

#### (二) 证券投资基金托管情况

截止到2006年4月末，中国银行已托管景宏、同盛、同智、兴安、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证100交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列(含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券)、嘉实货币市场、嘉实沪深300指数、嘉实超短债、银华优势企业、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、天同180指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏大盘精选、景顺长城景系列(含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票)、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、招商先锋、大成蓝筹稳健、湘财荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合股票型基金等40只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### (三) 主要人员情况

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

李礼辉先生，自2004年8月起担任中国银行副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。



1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

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

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

#### （四）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部的名称变更为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队。中国银行上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。总行托管及投资者服务部现有员工80余人，其中硕士学历以上人员24人，约占员工总数的30%，具有一年以上海外工作和学习经历的10余人。

#### （五）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

内部控制是指董事会、高级管理层和各级工作人员共同实施的，为实现中国银行经营目标，进行事前防范、事中控制、事后监督和纠正的动态过程和机制。内部控制的核心含义是职责分离、横向与纵向相互监督制约的机制。内部控制的具体表现形式是内部各种管理制度、

工作程序、具体控制方法和措施。

中国银行的内部控制目标是：

- (1) 确保国家法律规定和我行内部规章制度的贯彻执行；
- (2) 确保我行发展战略和经营目标的全面实施和充分实现；
- (3) 确保业务记录、财务信息和其他管理信息的及时、真实和完整。

## 2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 8 月 26 日成立以来,按照国家有关法律法规制定了新的公司章程,形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。董事会及其下设风险政策委员会是中国银行风险管理的最高决策机构,负责管理中国银行整体风险。董事会在其下设风险政策委员会的协助下,负责确定总体风险偏好,并监督管理层贯彻落实风险管理策略。风险政策委员会负责审定重大的信用风险、市场风险、操作风险(含法律及合规风险)、流动性风险等政策和制度,审定风险管理战略(包括风险偏好)以及风险管理程序和内部控制制度;在董事会的指导下,风险政策委员会负责审查和批准重大风险管理政策,包括但不限于:本行拟进入或被限制进入的风险领域;风险限额和整体风险承受标准;本行拟采取的风险管理技术;本行风险授权的程序和标准。监督管理层对风险管理战略、政策和程序的贯彻落实情况,确保风险管理政策与程序在本行内部得到统一遵守,并向董事会提出建议。总行风险管理部是具体实施风险管理的牵头组织部门,根据风险管理战略的要求,传导、落实和执行各项具体风险管理目标,监督指导分支机构和业务部门的风险管理工作。

中国银行股份有限公司高级管理层下设内部控制委员会,内部控制委员会主席由行长担任,副主席和委员为管理层成员。委员会负责维护全行内部控制体系的总体运行,决定全行内部控制的基本制度,评估本行内部控制体系及制度的有效性,识别内部控制体系的不足和缺陷,决定采取改进措施并督导相关措施的落实和执行。总行法律与合规部牵头维护全行内部控制体系的总体运行,协调、监控、督导全行内部控制管理制度的执行工作,同时作为委员会秘书处履行支持服务职责。总行监察稽核部负责对全行内部控制建设和执行情况实施稽核检查并督促整改。各一级分行设内部控制委员会,负责维护本行内部控制体系的总体运行,决定本行内部控制的基本制度,评估本行内部控制体系及制度的有效性,识别内部控制体系的不足和缺陷,决定采取改进措施,督导相关措施的落实和执行。

托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、

方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官职位和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

### 3、内部控制制度及措施

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

### 4、其他事项

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

#### (六) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## 五、 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

1、直销机构:华宝兴业基金管理有限公司(同上)

2、代销机构:

(1) 中国银行股份有限公司

住所:北京市复兴门内大街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：肖钢

客户服务统一咨询电话：95566

网址：[www.bank-of-china.com](http://www.bank-of-china.com)

(2) 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：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.cn](http://www.ccb.cn)

(3) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层

法定代表人：马国强

客服电话：400-8888-555

电话：0755-82493561

联系人：盛宗凌

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

(4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路618号

办公地址：上海市延平路135号

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818

传真：021-62583439

联系人：韩星宇

服务热线：400-8888-666；021-962588

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

(5) 中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：朱利

联系人：赵荣春、郭京华

电话：010-66568587

客户服务电话：800 - 820 - 1868

网站：www.chinastock.com.cn

(6) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：400-8888-108(免长途费)

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

(7) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客户服务电话：(020) 87555888 转各营业网点

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

(8) 长江证券有限责任公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华下路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华下路特 8 号

法定代表人：明云成

电话：027 - 65799560

传真：027 - 65799827

联系人：毕艇

服务热线：027 - 65799999

公司网址：www.cz318.com.cn

(9) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市唐山路 218 号

办公地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021 - 53594566

服务热线：021-962503

联系人：金芸

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

(10) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943167

联系人：黄健

客户服务热线：4008888111、0755-26951111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(11) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：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：王明权

电话：021-54033888

传真：021-54030294

服务热线：021-962505

联系人：孙洪喜

公司网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn) 或 [www.sywg.com.cn](http://www.sywg.com.cn)

(12) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

联系人：杨盛芳

客户服务热线：021-68419974

公司网站：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(13) 东吴证券有限责任公司

注册地址：江苏省苏州市十梓街 298 号

办公地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户服务电话：0512-96288

公司网站：www.dwzq.com.cn

(14) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

法定代表人：王明权

电话：021 - 68816000

传真：021 - 68815009

联系人：刘晨

客户服务热线：021 - 68823685

公司网址：www.ebscn.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构：华宝兴业基金管理有限公司（同上）

(三) 律师事务所和经办律师

名称：海华永泰律师事务所

住所：上海市浦东南路 855 号世界广场 24 楼

办公地址：上海市浦东南路 855 号世界广场 24 楼

负责人：颜学海

联系电话：(021) 58773177

传真：(021) 58773268

联系人：冯加庆

经办律师：冯加庆、李楠

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 61238888

传真：(021) 61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：肖峰、陈玲

## 六、 基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字【2005】162号《关于同意华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从2005年9月27日起向社会公开发售，至2005年11月11日止，共募集535,410,310.23份基金份额，有效认购户数为3397户。



## 七、 基金合同生效

本基金基金合同于 2005 年 11 月 17 日正式生效。

## 八、 基金份额的申购与赎回

### (一) 基金份额申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。

### (二) 申购与赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。

#### 2、 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2005 年 12 月 19 日起开始办理日常申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，视同下次开放时间提交的申请。

### (三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理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、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构的基金份额进行处理时，申（认）购确认日期在先的基金份额先赎回，申（认）购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金的申购和赎回以书面或经基金管理人认可的其他方式进行；

6、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三个工作日予以公告。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人须按基金管理人和销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，在其提出赎回申请的销售机构（网点）交易账号内必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。申购不成功或无效，申购款项将退回投资人账户。

投资人赎回申请成功后，赎回款项在自成交确认日起五个工作日内划往投资人银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

#### (五) 申购与赎回的数额限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过代销网点申购本基金单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

##### 2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精

确到小数点后两位,单笔赎回份额不得低于 100 份。基金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 份的,在赎回时需一次全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的规定,但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

(六) 基金的申购费和赎回费

1、投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下:

申购金额	申购费率
500 万(含)以上	每笔 1000 元
大于等于 200 万,小于 500 万	申购金额的 0.5%
大于等于 100 万,小于 200 万	申购金额的 1.0%
大于等于 50 万,小于 100 万	申购金额的 1.2%
50 万以下	申购金额的 1.5%

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间	费率
两年以内(含两年)	0.5%
两年 - 三年(含三年)	0.3%
三年以上	0%

本基金的赎回费用由赎回人承担,其中 25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(七) 申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用=申购金额×申购费率

净申购金额=申购金额 - 申购费用

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以申请当日基金份额净

值为基准计算的份额，申购份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

例一：假定投资人申购本基金，T日的基金份额净值为1.2000元，申购金额为1,000元，那么申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购金额（元，A）	1,000
适用费率（B）	1.5%
申购费用（C=A*B）	15
净申购金额（D=A-C）	985
申购份额（=D/1.2000）	820.83

## 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回总额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回金额为赎回总额扣除相应的费用。赎回总额保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分代表的资产归基金财产所有。

例二：假定投资人赎回本基金，T日的基金份额净值为1.2000元，投资人赎回10,000份，投资人持有不到1年，则：

赎回份额（A）	10,000
赎回总额（B=A*1.2000）	12,000
适用费率（C）	0.5%
赎回费用（D=B*C）	60
赎回金额（=B-D）	11,940

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

## （八）申购与赎回的注册、变更登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束之前可以撤销。

2、投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前三个工作日在指定媒体予以公告。

#### (九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- (5) 基金管理人认为某笔申购会有损于现有基金份额持有人利益；
- (6) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资人。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- (1) 拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- (2) 拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- (3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、在如下情况下，基金管理人可以拒绝接受或暂停接受投资人的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (3) 发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

5、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

#### (十) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请有困难，或认为兑付投资人的赎回申请可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个账户当日办理的赎回份额；未受理部分除投资人在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，自动延迟至下一开放日办理赎回。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，以此类推，直到全部赎回为止。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在三个工作日内通过指定媒体、基

金管理人公司网站或代销机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

### 3、连续发生巨额赎回的处理方式

本基金连续两个开放日以上（含两日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间二十个工作日，并应当在指定媒体公告。



## 九、与基金管理人管理的其他基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定,在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

## 十、基金的投资

### (一) 本基金投资目标、理念、范围和策略

#### 1、投资目标

通过对基金组合的动态优化管理，使基金收益持续稳定超越比较基准，并追求单位风险所获得的超额收益最大化。

#### 2、投资理念

本基金认为股票的预期收益由“价值因子”和“成长因子”共同驱动，不同阶段二者对股票预期收益的驱动作用不同，把握其变动趋势，自下而上精选个股，可以增加超额收益（值）。

#### 3、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

#### 4、投资策略

本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势，调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例，自下而上精选个股，获取超额收益。

在正常的市场情况下，本基金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的 60% - 95%；债券占 0% - 40%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。

#### (1) 股票投资策略

##### 1) 自下而上精选个股策略

本基金认为股票的预期收益由价值因子和成长因子共同驱动。在个股精选过程中将精选指标分为“价值因子”和“成长因子”，个股的价值指标和成长指标都经过行业、公司规模的调整，给予标准化评分。

##### 2) 动态优化策略

本基金基于对中国股票市场历史数据的统计研究，发现“价值因子”和“成长因子”在不同阶段对股票预期收益的驱动作用不尽相同，且某一因子的驱动作用具有短期趋势特征。通过跟踪近期价值因子与成长因子对股票预期收益驱动作用的发展趋势，确定当期个股“价值因子”和“成长因子”得分的权重，从而得出当期个股综合得分并进行排名。

本基金将重点投资得分排名靠前的股票，并结合本公司股票投资研究平台，对股票价格

逐一评估，确定其是否具有投资价值。同时考虑个股对投资组合的边际风险贡献度、个股的流动性等因素，调整个股投资比例，实现组合优化。

### 3) 自下而上驱动的行业配置策略

投资组合的目标行业配置比例为由个股得分排名靠前的股票组合形成的行业配置比例。

## (2) 债券投资策略

1) 本基金债券投资的主要目的是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险，同时获取债券投资的收益。

2) 本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

## (3) 权证投资策略

根据华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同的规定，动力组合基金具备投资权证的条件。动力组合基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

## 5、业绩比较基准

本基金的股票投资部分的业绩比较基准采用 80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均值，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数收益率。本基金定位为股票型基金，债券投资只是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险；根据本基金的投资比例范围，本基金的业绩比较基准为：

80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均+20%上证国债指数收益率。

## 6、风险 - 收益特征

本基金是一只积极型的股票投资基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

### (二) 投资程序

#### 1、投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略、资产配置、价值/成长权重配比策略的调整做出决策。

#### 2、金融工程部负责跟踪数量分析模型

金融工程部实时跟踪数量分析模型，定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理，定期判断价值/成长权重配比策略是否符合市场特征。

### 3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告,通过走访政府决策部门和研究部门,研究经济形势、经济政策(货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等)、重大技术发明等,撰写宏观研究报告,就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名,以排名前 50%的股票为基准库,考察上市公司的核心业务竞争力、经营能力和公司治理结构等,预测上市公司未来 2 - 3 年的经营情况,选择重点上市公司进行调研,撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告,对个股买卖提出具体建议。

### 4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展,结合量化分析等工具对股市做出判断,提出投资组合的资产配置比例建议,同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告,形成投资计划提交投资决策委员会,并根据投资决策委员会的决策,具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后,基金经理向交易部下达具体的投资指令,交易员根据投资决定书执行指令。

### 5、绩效评估

主要包括四项核心功能:风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献,由绩效评估人员利用相关工具评估。

### 6、内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、内控审计风险管理部负责内控制度的制定,并检查执行情况。

#### (三) 投资限制

##### 1、组合限制

(1) 持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10% ;

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

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

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五 ;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的百分之三 ;

(6) 本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

2、如果法律法规对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

### 3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

### 4、禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是法律法规另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；但有关监管机构允许的情况除外；

(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。

### (四) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；

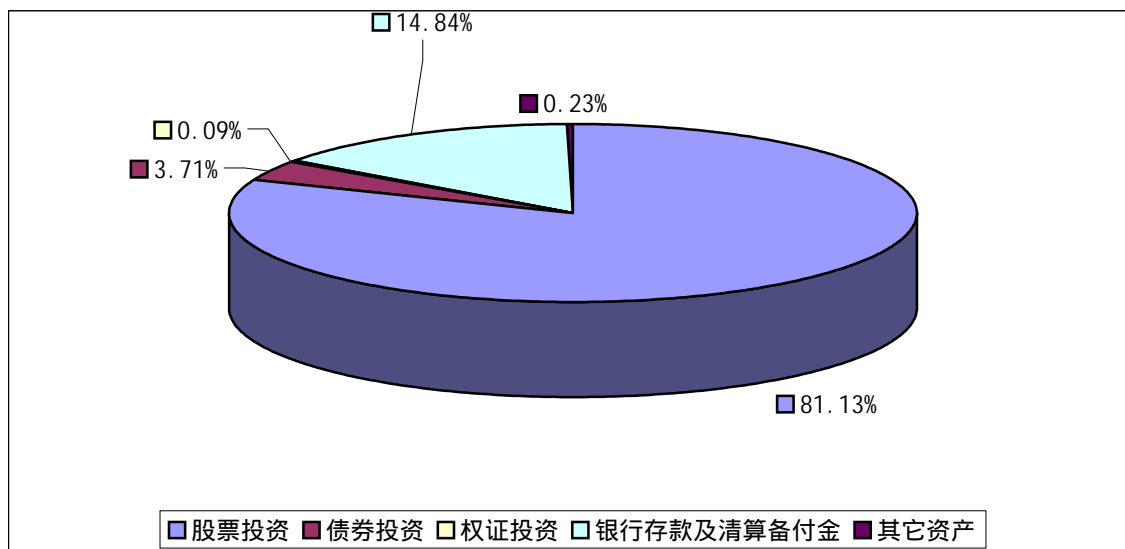
4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

### (五) 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2006 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占总资产比例
股票	286,054,830.33	81.13%
债券	13,074,100.00	3.71%
权证	334,006.40	0.09%
银行存款和清算备付金合计	52,323,234.30	14.84%
其他资产	822,305.84	0.23%
合计	352,608,476.87	100.00%



2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
2	采掘业	20,034,000.00	5.76%
3	制造业	125,019,920.30	35.95%
	其中：食品、饮料	33,604,216.00	9.66%
	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
	木材、家具	0.00	0.00%
	造纸、印刷	0.00	0.00%
	石油、化学、塑胶、塑料	51,461,805.06	14.80%
	电子	5,252,000.00	1.51%
	金属、非金属	14,446,600.00	4.15%
	机械、设备、仪表	11,219,887.48	3.23%
	医药、生物制品	9,035,411.76	2.60%
	其他制造业	0.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	20,512,000.00	5.90%
5	建筑业	0.00	0.00%
6	交通运输、仓储业	17,795,438.79	5.12%
7	信息技术业	25,369,388.94	7.30%
8	批发和零售贸易	4,101,700.00	1.18%
9	金融、保险业	28,719,142.30	8.26%

10	房地产业	42,916,240.00	12.34%
11	社会服务业	1,587,000.00	0.46%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	0.00	0.00%
	合计	286,054,830.33	82.27%

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600900	G 长 电	3,200,000	20,512,000.00	5.8993%
2	600036	G 招 行	2,700,016	17,361,102.88	4.9931%
3	600383	金地集团	1,925,000	16,786,000.00	4.8277%
4	000866	扬子石化	1,200,000	16,620,000.00	4.7799%
5	600519	贵州茅台	260,000	16,190,200.00	4.6563%
6	600028	中国石化	3,000,000	15,150,000.00	4.3571%
7	600002	齐鲁石化	1,200,000	12,132,000.00	3.4892%
8	600309	烟台万华	660,006	11,556,705.06	3.3237%
9	000063	G 中 兴	357,538	10,951,388.94	3.1496%
10	600549	G 厦 钨	530,000	10,870,300.00	3.1263%

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国 债	13,074,100.00	3.76%
2	金 融 债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企 业 债	0.00	0.00%
5	可 转 债	0.00	0.00%
6	其 他	0.00	0.00%
	合 计	13,074,100.00	3.76%

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	02 国债	13,074,100.00	3.76%
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

6、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

(2) 本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势，调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例，自下而上精选个股，没有特定的股票备选库。

(3) 基金的其他资产构成

单位：元

项目	金额
交易保证金	316,700.00
应收利息	160,490.10
应收申购款	81,262.50
待摊费用	263,853.24
合计	822,305.84

(4) 本基金持有的权证均为股权分置改革被动持有，至今尚未发生主动投资权证的交易。本基金在本报告期内持有的权证明细如下：

权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）	期末市值（元）
580997	招行 CMP1	721,933.00	0.00	0.00
030002	五粮 YGC1	120,900.00	0.00	129,121.20
038004	五粮 YGP1	127,100.00	0.00	204,885.20
总计		969,933.00	0.00	334,006.40



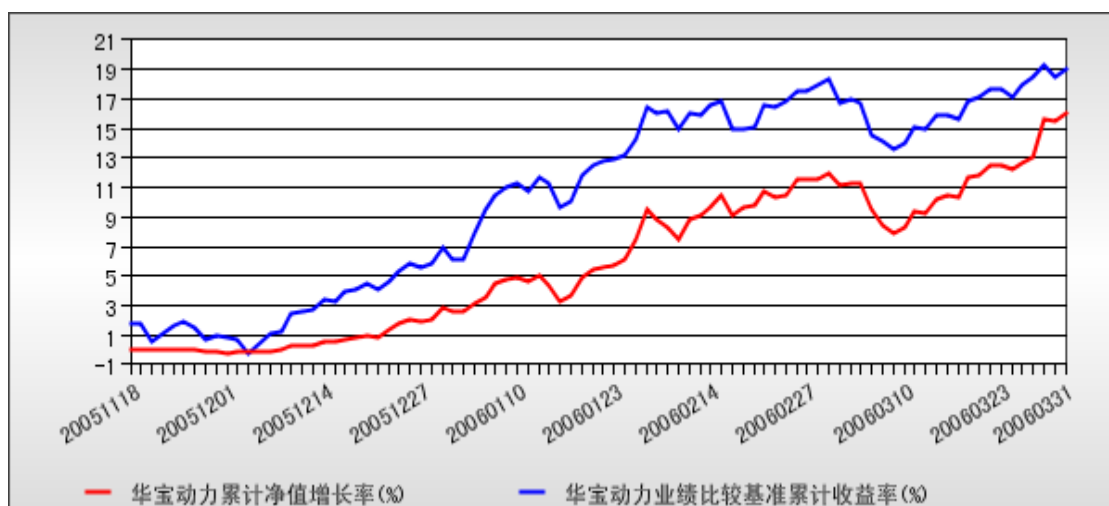
## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2006 年 3 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

### 1、净值增长率与同期比较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2006/01/01-2006/03/31	13.05%	0.72%	12.09%	0.77%	0.96%	-0.05%
2005/11/18-2005/12/31	2.64%	0.20%	6.19%	0.63%	-3.55%	-0.43%
2005/11/18-2006/03/31	16.03%	0.59%	19.04%	0.72%	-3.01%	-0.13%

### 2、基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比



本基金合同于2005年11月17日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

按照基金合同的约定，自基金合同生效起的6个月内达到规定的资产组合，截至报告日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

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（例如基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 十二、基金财产

### (一) 基金资产总值

基金财产包括：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

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

### (二) 基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件以本基金的名义开立基金银行存款账户，以托管人与本基金的联合名义开立证券账户。开立的本基金专用账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相互独立。

### (四) 基金财产的保管与处分

1、本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、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、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、托管费以及基金合同约定的其他费用。

3、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范围。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十三、基金资产估值

### (一) 估值目的

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

### (二) 估值日

基金合同生效后，每工作日对基金资产进行估值。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### (四) 估值方法

#### 1、股票估值方法

(1) 上市流通证券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市股票的估值：

送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

首次发行的股票，按成本价估值。

(3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则不进行估值。

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

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值办法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到

的净价估值。

(3) 可转换债券按交易所提供的该证券收盘价(减应收利息)进行估值。

(4) 未上市债券按其成本价估值。

(5) 在银行间同业市场交易的债券按不含息成本与市价孰低法估值。不含息成本是指取得债券成本(不含应计利息),市价是指银行间同业市场公布的加权平均价,如果该日没有交易的品种,以最近一日的市场平均价为基准;如该债券长期没有交易或交易异常,按第(6)条处理;当成本与市价不一致时,取最低价。

(6) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)-(5)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)-(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(7) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以书面形式报给基金托管人,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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) 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、托管人无法准确评估基金财产价值时;
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### (七) 基金份额净值的确认

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

#### (八) 估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时,视为基金份额净值估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值估值确认出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,并采取合理的

措施防止损失进一步扩大；计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

## 2、差错类型

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

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

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

## 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿。基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

（1）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，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（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，不对第三人负责；

（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，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) 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三人造成基金财产的损失，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、行政法规、基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 1 项中的第 (4) 小项条款、第 2 项中的第 (6) 小项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十四、基金收益与分配

### (一) 收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

2、基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### (二) 收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式，投资人可以选择取得现金或者将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额（下称“红利再投资”），以基金份额持有人在分红权益登记日前的最后一次经确认的选择为准；基金份额持有人事先未做出选择的，默认为投资人选择取得现金；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多六次；基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

4、基金收益分配比例每次不低于符合上述基金分红条件的可分配收益的 50%；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### (三) 收益分配方案

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

### (四) 收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在二日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

### (五) 收益分配中发生的费用

1、收益分配选择红利再投资的免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值转为相应基金份额。

## 十五、基金的费用

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### 2、费率水平、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指



令，基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第 1 款第 (3) 至第 (7) 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金管理人和基金托管人可协商酌情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，但应报经中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

## (二)与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“(六)本基金的面值、认购费用及计算公式”中的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的“(六)基金的申购费和赎回费”中的相关规定。

## 十六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后两日内公告。

## 十八、基金的信息披露

### （一）披露原则

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

### （二）基金合同、托管协议、招募说明书、份额发售公告

1、基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人应当在基金份额发售的三日前,将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在各自公司网站上。

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

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、基金合同生效后,基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的十五日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

### （三）基金资产净值、基金份额净值公告

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

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

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

### （四）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制,由基金托管人复核。基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

1、基金年度报告:基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报

告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

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

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

#### （五）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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、提前终止基金合同；
- 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、变更基金代销机构；
- 20、更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、基金份额上市交易；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （六）公开澄清

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。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

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

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

对投资人按上述方式所获得的文件及其复印件,基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

## 十九、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

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

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 2、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人 有义务接受投资人的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行股票买卖。然而，市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的股票，其流动性都各不相同。一般来说，股市上涨期，市场流动性较高；股市下跌期，市场流动性低；大盘蓝筹股流动性高，小盘垃圾股流动性较低。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出股票，或者必须付出较高成本才能买进或卖出股票，这样，就在两个方面产生了风险：

（1）当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进股票，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

（2）当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出股票，从而影响本基金的投资业绩。

#### 3、趋势判研及精选个股风险

本基金根据价值/成长权重配比策略每月改变评估个股的价值因子和成长因子的权重，

由于市场等方面因素可能导致短期内某因子驱动作用的趋势不显著或其对立因子趋势显著，使基金实际投资的收益率低于预期收益率。本基金根据整体量化分析程序精选的排名靠前的股票可能表现不如预期。另外，本基金也可能因为频繁调整价值/成长因子权重，导致股票库股票变动过大，增加交易成本，降低基金的收益水平。

#### 4、权证投资风险

权证是金融衍生品的一种，具有高杠杆、高风险、高收益的特征，风险较大。动力组合基金将可能投资权证，请基金持有人注意投资风险。

#### 5、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

#### 6、操作或技术风险

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

#### 7、合规性风险

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。

#### 8、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，可能导致基金财产的损失。

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

### (二) 声明

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

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



## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；

（2）变更基金的投资目标、投资范围、投资策略；

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

（4）其他对基金份额持有人的权利义务产生重大影响的事项。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化的，或因当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

1、有下列情形之一的，经中国证监会核准后，基金合同终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）基金管理人、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人、基金托管人的职务，在六个月内没有其他适当的基金管理公司、基金托管机构承受其原有权利及义务的；

（3）基金合并、撤消；

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金合同终止时，应当按照法律法规和基金合同规定，对基金进行清算。清算报告经注册会计师审计、律师事务所确认并报中国证监会备案后公告，基金合同于公告之日终止。

### （三）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) 自基金合同终止事由之日起三十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、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) 基金合同终止时,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) 基金财产清算组作出清算报告;
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (7) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会;
- (9) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (10) 公布基金清算公告;
- (11) 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

基金财产按下列顺序清偿:

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

基金财产未按前款(1)至(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

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有关文件由基金托管人保存十五年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### (一) 基金合同当事人权利及义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

##### (1) 基金管理人的权利

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

2) 自基金合同生效之日起,基金管理人依照法律法规和基金合同管理和运用基金财产,并独立决定其投资方向和投资策略;

3) 根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;

4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;

5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;

6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定,致使基金财产或其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构,必要时应采取保护措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;

7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;如果基金管理人认为代销机构的行为违反了法律法规、基金合同或代销协议,基金管理人应行使法律法规、基金合同或代销协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施,包括但不限于停止、终止销售代理协议的执行,更换代销机构,以保护基金财产的安全和相关当事人的利益;

8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

9) 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;

10) 在法律法规允许的前提下,依法为基金进行融资;

11) 依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益的分配方案;

12) 按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利;

13) 在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;

14) 依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;

15) 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;

16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;

17) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

1) 基金管理人应遵守《基金法》、基金合同及其他有关规定,为基金份额持有人的最大利益处理基金事务;

2) 自基金合同生效之日起,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,依法管理和运用基金财产;

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

4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务;

5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;

6) 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固有财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账,进行证券投资;

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

8) 接受基金托管人依法进行的监督;

9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合基金合同等法律文件的规定,按照有关规定计算并公告基金份额净值,确定基金份额认购、申购、赎回的价格;

10) 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;

- 11) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；
- 12) 按基金合同规定制定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 13) 按照法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 17) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 18) 组织并参加基金财产清算组对基金财产进行清算，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 23) 法律法规、基金合同和依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

### (1) 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 3) 监督本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定，致使基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时

呈报中国证监会和银行业监督管理机构,必要时采取措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;

7) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;

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

3) 建立健全内部控制、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,保证其托管基金财产的完整与独立;对不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

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

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

7) 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;

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

9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格;

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

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

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

13) 依法办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

14) 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,还应说明基金托管人是否采取了适当的措施;

15) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料,保存基

金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

17) 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；

18) 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；

19) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

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银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

22) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

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

24) 法律法规、基金合同和依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

#### (1) 基金份额持有人权利

基金投资人购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资人自取得依据基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

1) 按基金合同的规定分享基金财产收益；

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) 按照基金合同规定要求召开基金份额持有人大会；

5) 按照基金合同规定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) 因基金管理人、基金托管人、销售机构的过错导致其损失的求偿权；

8) 对基金管理人、基金托管人、销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。



(2) 基金份额持有人义务

- 1) 遵守有关法律法规和基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及基金其他当事人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决定；
- 6) 返还持有基金份额过程中获得的不当得利；
- 7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

1、 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或基金份额持有人合法的代理人共同组成。

2、 有以下事由情形之一时，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改或终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- (2) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 更换基金管理人；
- (5) 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；
- (6) 本基金与其他基金的合并；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、 以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费或其他应由基金财产承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

#### 4、 召集方式

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

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

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

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

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

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

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

#### 5、 通知

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在指定媒体公告。

基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 投票委托书的内容要求（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；
- 6) 表决方式；
- 7) 会务常设联系人姓名、电话；
- 8) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 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) 如采用通讯表决方式，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

(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。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者的身份证明及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、授权委托书及代理人身份证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证和基金管理人持有的登记资料相符；

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

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 15 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。

在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:

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

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见;

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

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表, 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, 并与登记注册机构记录相符;

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表决的时间(至少应在 15 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。

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, 否则表明符合法律法规、基金合同和会议通知规定且与登记注册机构记录相符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。

## 7、 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、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 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公告。

3) 对于基金份额持有人提交的提案 (包括临时提案), 大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系, 并且不

超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

4) 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。

5) 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,未获得基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,需由单独或合并持有权益登记日基金总份额 15%以上的基金份额持有人提交;基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获得基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

6) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (2) 议事程序

在现场开会的方式下,首先由召集人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。召集人自决议通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案,自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 天公布提案,在所通知的表决截止日期第二个工作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。召集人自决议通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案,自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

## 8、 表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### 1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上

(含三分之二)通过。

## 2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的百分之五十以上(含百分之五十)通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表明符合法律法规、基金合同和会议通知规定且与登记注册机构记录相符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。

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。

## 9、 计票

### (1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表,如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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,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三名基金份额持有人担任监票人。

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

3) 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果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者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。

### (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。

## 10、 生效与公告

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

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

(3) 基金份额持有人大会决议应当自生效之日起 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体公告。

### (三) 基金合同终止

1、有下列情形之一的，经中国证监会核准后，基金合同终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止；

(2) 基金管理人、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人、基金托管人的职务，在六个月内没有其他适当的基金管理公司、基金托管机构承受其原有权利及义务的；

(3) 基金合并、撤消；

(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金合同终止时，应当按照法律法规和基金合同规定，对基金进行清算。清算报告经注册会计师审计、律师事务所确认并报中国证监会备案后公告，基金合同于公告之日终止。

### (四) 争议解决方式

1、基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

### (五) 基金合同的存放和获得方式

基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同登载在网站上。

基金合同可印制成册，供基金投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记

机构办公场所查阅，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十二、基金托管协议内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称： 华宝兴业基金管理有限公司  
住所： 上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼  
法定代表人： 郑安国  
注册资本： 1 亿元人民币  
经营范围： 基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）批准的其他业务  
组织形式： 中外合资经营  
营业期限： 持续经营

#### 2、基金托管人

名称： 中国银行股份有限公司  
住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号  
法定代表人： 肖钢  
经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。  
企业类型： 股份有限公司  
注册资本： 人民币壹仟捌佰陆拾叁亿零叁拾伍万贰仟肆佰玖拾柒元捌角  
存续期间： 持续经营



## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关证券法规的规定，托管人应对基金管理人就基金财产的投资对象、基金财产的投资组合比例、基金财产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（1）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（2）基金托管人发现基金管理人的指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应该拒绝执行，并通知基金管理人，向中国证监会报告。

（3）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。

（4）如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资人的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

### 2、基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否妥善保管基金的全部财产、是否将基金财产和固有财产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（1）基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权代表基金要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的

损失。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规的规定,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规和基金合同,基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金财产的安全和基金投资人的利益,包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

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

### (三) 基金财产保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产的保管责任由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,谨慎、有效的持有并保管基金财产。

(2) 基金托管人应当设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;建立健全内部风险控制制度,对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督,防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施(包括硬件和软件),并对设备和设施进行维修、维护和更换,以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定外,不为自己及任何第三人谋取利益,基金托管人违反此义务,利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,所得利益归于该基金财产;基金托管人不得将基金财产转为其固有财产,不得将固有财产与

基金财产进行交易,或将不同基金财产进行相互交易;违背此款规定的,将承担相应的责任,包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任。

(5) 基金托管人必须将基金财产与固有财产严格分开,将基金财产与其托管的其他基金财产严格分开;基金托管人应当为基金设立独立的账户,建立独立的账簿,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面具有实质的独立性。

(6) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产;

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金财产;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。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金设立募集期满或基金宣布停止募集时,由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资,并分别出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的2名以上(含2名)中国注册会计师签字方为有效。

(3) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入基金托管人以基金名义开立的基金银行账户中,并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

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

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

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

## 4、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金,以托管人和本基金联名的方式分别在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设证券账户。

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

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金、结算互保基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) 基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理,而不同于上述关于账户开设、使用的规定。

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

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

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义向基金托管人提出申请进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管与结算账户,并代表基金进行债券和资金的结算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国银监会进行报备。

#### 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,由基金托管人以基金的名义负责开立。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实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库,但要与非本基金的其他实物证券分开保管;也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 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财产有关的重大合同的原件由基金托管人保管。除本托管协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本。

#### (四) 基金资产净值计算与复核

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

2、基金管理人应每工作日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日该基金的基金份额净值,并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在签名、盖章后以加密传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人;如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异,且双方经协商未能达成一致,基金管理人可以按照其对基金净值的计算结果对外予以公布,基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

#### (五) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册,包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册,应当根据有关法律法规的规定妥善保管之。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的,基金管理人(注册登记机构)应当提供任何必要且合理的协助。

#### (六) 争议处理和适用法律

1、本托管协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本托管协议产生的或与本托管协议有关的争议可通过友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于上海的中国国际经济贸易仲裁委员会,根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外,各方当事人仍应履行本托管协议的其他规定。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托管协议规定的义务,维护各基金份额持有人的合法权益。

(七) 托管协议的修改与终止

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

2、发生以下情况，本托管协议终止：

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

## 二十三、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。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

#### 1、基金投资人对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。在每季度结束后的15个工作日内向该季度有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单在每年度结束后15个工作日内对本基金的所有份额持有人以书面或电子文件形式寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金的基金份额持有人除外)。

#### 2、其他相关的信息资料

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记注册机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### （三）定期定额投资计划

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本基金开放申购赎回后公告。

### （四）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

### （五）电话查询及交易服务

华宝兴业自动电话语音查询、交易系统，为客户提供安全高效的电话查询服务。对直销客户还提供电话交易服务。

### （六）在线服务

基金管理人利用自己的网站（www.fsfund.com）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

#### （七）资讯服务

1、投资人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：021-38784747，该电话可转人工座席。

直销中心电话：021-50499588 - 301、302

传真：021 - 50499663，50499667

#### 2、互联网站

公司网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

#### （八）客户投诉和建议处理

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



## 二十四、其他应披露事项

(一) 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, 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《华宝兴业基金管理有限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决议。本基金托管人不受《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》的约束。

(三) 本报告期内, 本基金在制定媒体刊登的公告如下: 2005年12月14日刊登了《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》、2006年1月18日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于代销机构华夏证券变更为中信建投证券的公告》、2006年3月30日刊登了《关于华宝兴业动力组合股票型证券投资基金的权证投资方案的公告》、2006年4月8日刊登了《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金分红预告》、2006年4月13日刊登了《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金分红公告》、2006年4月20日刊登了《动力组合证券投资基金2006年第一季度报告》、2006年5月10日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于推出本公司基金优惠申购费率活动的公告》。

(四) 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。

## 二十五、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住所,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。

## 二十六、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资人查阅。

- (一) 中国证监会核准华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (八) 中国证监会要求的其他文件

投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2006年6月30日