

巨田基础行业证券投资基金

招募说明书

基金发起人：巨田基金管理有限公司

基金管理人：巨田基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行

重要提示：

发起人保证招募说明书的内容真实、准确、完整，本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金资料摘要

基金名称	巨田基础行业证券投资基金
基金类型	契约型开放式
批准机关及批准文号	中国证监会证监基金字[2004]11 号
投资目标	分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金持有人谋求长期、稳定的投资回报
投资范围	国内证券市场依法发行上市的公司 A 股和债券以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于基础行业股票的比例不低于股票资产的 80%
收益分配	在符合基金分红条件的前提下，每年至少 1 次，投资者可以选择现金分红或红利再投资
基金单位面值	每基金单位的面值为人民币 1.00 元
认购费率	认购费率为基金认购金额的 1.0%
募集对象	合格的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）
募集方式	通过基金销售网点（包括基金销售代理人的代销网点和本基金管理人的直销网点，具体名单见发行公告）公开发售
募集期限	自招募说明书公告之日起不超过 3 个月
申购、赎回开始时间	自基金成立日后，即可办理申购；基金成立 30 个工作日后开始办理赎回。
申购费率	申购金额的 1.5%
赎回费率	赎回金额的 0.5%
每笔认购、申购最低金额	100 元
每笔赎回最低份额	100 份基金单位
基金单位净值	T 日的基金单位净值在当天收市后计算，以四舍五入的方法精确到 0.0001 元，并于次日公告
基金份额的计算	保留到小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归属基金资产
基金发起人	巨田基金管理有限公司
基金管理人	巨田基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行
注册登记人	巨田基金管理有限公司
签署日期	2004 年 2 月

上述内容仅为摘要，须与本招募说明书后面所载之详细资料一并阅读。

巨田基础行业证券投资基金产品说明书概要

投资目标：分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金持有人谋求长期、稳定的投资回报。

投资理念：立足“发现价值、把握机遇、创造财富”，把握基础行业长期稳定的增长趋势，在注重控制基金资产风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资范围：国内证券市场依法发行上市的公司 A 股和债券以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于基础行业股票的比例不低于股票资产的 80%。

投资策略：本基金看好基础行业的发展前景，中长期持有以基础行业股票为主的证券投资组合，并注重资产在行业间的配置，适当进行时机选择。

在正常市场情况下，股票投资比例浮动范围：基金净值的 50%—75%；债券投资比例浮动范围：基金净值的 20%—45%；现金资产比例浮动范围：基金净值的 5%—20%。当市场出现极端情况，系统性风险超出正常水平时，投资比例可作一定调整，但在合理时间内，投资比例将恢复正常市场情况下的水平。

选股标准：针对基础行业特点，对上市公司进行财务状况分析、内在价值分析和相对价值分析，研究内容包括上市公司核心竞争力、持续经营能力、公司治理结构、未来经营状况和现金流、财务状况和相对价值等方面。以持续盈利和稳定增长为核心标准，对上市公司进行分行业综合评级，立足于发现具有长期投资价值的上市公司，进而根据行业配置要求构造投资组合。

业绩比较基准：上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信全债指数×20%+同业存款利率×5%

复合指数=（上证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×上证综指 +（深证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×深证综指

风险收益特征：2000 年以来的模拟分析结果显示，基础行业模拟组合长期收益优于比较基准，BETA 值、标准差等风险指标小于比较基准，具有良好的风险收益特征。

风险管理机制与手段：风险管理贯穿于基金运作的整个过程，以投资风险的

控制为重点，通过股票组合风险管理、市场风险管理、流动性风险管理等手段确保基金在较低风险范围内运行。

目 录

一、绪言	1
二、释义	1
三、基金设立	3
四、本次发行有关当事人	4
五、本次发行安排	10
六、基金成立	12
七、基金管理人	13
八、基金管理人的风险管理和内部控制制度	20
九、基金托管人	23
十、基金投资	29
十一、风险揭示	33
十二、基金费用	34
十三、基金资产	35
十四、基金资产估值	36
十五、基金税收	39
十六、基金收益和分配	39
十七、基金的会计和审计	40
十八、基金申购、赎回	41
十九、基金持有人的权利、义务和相关服务	46
二十、基金的信息披露	53
二十一、基金终止	55
二十二、基金清算	55
二十三、招募说明书存放及查阅方式	56
二十四、备查文件	57

一、绪言

巨田基础行业证券投资基金由巨田基金管理有限公司依据《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称“《暂行办法》”）及其实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称“《试点办法》”）、《巨田基础行业证券投资基金基金契约》（以下简称“《基金契约》”）及其它有关规定发起设立。

本招募说明书依据《暂行办法》及其实施准则等有关法规以及《基金契约》编写，并经中国证监会核准。

基金发起人已批准本招募说明书，承诺其中不存在任何虚假内容、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的资料申请发行的。本招募说明书由巨田基金管理有限公司解释。本基金发起人和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。

二、释义

在本《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

基金或本基金	指巨田基础行业证券投资基金
《基金契约》	指《巨田基础行业证券投资基金基金契约》及对该契约的任何修订和补充
《托管协议》	指《巨田基础行业证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充
招募说明书	指《巨田基础行业证券投资基金招募说明书》
发行公告	指《巨田基础行业证券投资基金发行公告》
公开说明书	指本基金成立后每6个月公告1次的有关基金概要、基金投资组合公告、基金经营业绩、重要变更事项和其他按法律规定应披露事项的说明书
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
《暂行办法》	指1997年11月14日经国务院批准发布并实施的《证券投资基金管理暂行办法》
《试点办法》	指2000年10月8日由中国证监会发布并实施的《开放式证券投资基金试点办法》

《基金契约》当事人	指受《基金契约》约束，根据《基金契约》享受权利并承担义务的基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金持有人
基金发起人	指巨田基金管理有限公司
基金管理人	指巨田基金管理有限公司
基金托管人	指中国光大银行
注册登记业务	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记人	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人为巨田基金管理有限公司或接受巨田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
销售代理人	指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及销售代理人
基金持有人	指依法取得和持有依据《基金契约》发行的基金份额的投资者
基金投资者	指个人投资者和机构投资者
个人投资者	指依法可以投资证券投资基金的具有中华人民共和国国籍的中国公民
机构投资者	指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体法人或其他组织，及中国证监会批准的可以投资开放式证券投资基金的其他机构投资者（如QFII）。
基金成立日	指基金达到成立条件后，基金发起人宣告基金成立的日期
基金终止日	指《基金契约》规定的基金终止事由出现后按照《基金契约》规定的程序并经中国证监会批准终止基金的日期
设立募集期	指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过3个月
存续期	指基金成立至终止的不定期期限
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所及其他相关证券交易场所的正常交易日
T日	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
认购	指在本基金设立募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为
申购	指在本基金存续期间，投资者向基金管理人申

	请购买本基金基金单位的行为
赎回	指在本基金存续期间，基金持有人按《基金契约》规定的条件，要求基金管理人购回其持有的全部或部分本基金基金单位的行为
基金账户	指注册登记人为基金持有人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金单位余额及其变动情况的账户
基金交易账户	指销售人为投资者开立的记录投资者通过该销售人买卖巨田基础行业证券投资基金份额的变动及结余情况的账户
元	指人民币元
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去负债后的价值
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资产单位净值的过程
基础行业	本基金定义的基础行业包括：能源行业、交通运输行业、信息基础设施行业、公用设施服务业
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站，包括但不限于《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、上海证券交易所网站、深圳证券交易所网站
不可抗力	指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括：相关法律、法规和规定的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等

三、基金设立

（一）基金设立的依据

本基金由发起人依照《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关规定发起设立，并经中国证监会于 2004 年批准，批准文号为证监基金字[2004]11 号文。

（二）基金存续期间

本基金存续期为不定期。

（三）基金类型

契约型开放式。

（四）基金契约

《基金契约》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自取得依《基金契约》所发行的基金单位，即成为基金持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对《基金契约》的承认和接受，并按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其它有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅《基金契约》。

四、本次发行有关当事人

（一）基金发起人

名称：巨田基金管理有限公司

地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

法定代表人：王一楠

成立时间：2003 年 3 月 14 日

注册资本：人民币 1 亿元

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：50 年

电话：0755—82993636

传真：0755—82990384

联系人：季莹、黄萍

（二）基金管理人

巨田基金管理有限公司（同上）

（三）基金托管人

名称：中国光大银行

地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：王明权

成立时间：1992 年 8 月 18 日

组织形式：股份制商业银行

注册资本：人民币 82.17 亿元

存续期间：持续经营

电话：(010) 68561044

传真：(010) 68560661

(四) 代销机构

1、中国光大银行

地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：王明权

成立时间：1992 年 8 月 18 日

组织形式：股份制商业银行

注册资本：人民币 82.17 亿元

电话：(010) 68561044

传真：(010) 68560661

联系人：贾峻

网址：www.cebbank.com

2、申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：王明权

电话：021-54033888

联系人：胡洁静

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

3、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

客户服务电话：(021) 962588、800-820-6888

传真：(021) 62583439

联系人：芮敏祺

联系电话：021-62580818-213

网址：www.gtja.com

4、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566

传真：(021) 53858549

联系人：金芸

客户服务电话：021-962503

网址：www.htsec.com

5、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419125

传真：(021) 68419867

联系人：杨盛芳

客户服务电话：021-68419125

网址：www.xyzq.com.cn

6、华夏证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区新中街 68 号

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：周济谱

电话：(010) 65186758

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400—8888—108（免长途费）；

网址：www.csc108.com

7、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

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943167

传真：0755-82943237

联系人：钟俊杰

客户服务电话：4008888111、0755-26951111

网址：www.newone.com

8、广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 层

法定代表人：陈云贤

客户服务电话：020—87555888—875、895

传真：(020) 87557985

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

9、大同证券经纪有限责任公司

注册地址：山西大同大北街 13 号

法定代表人：董祥

电话：(0351) 4193679

传真：(0351) 4192803

联系人：吴守洲

客户服务电话：0351-4193593

网址：www.dtsbc.com.cn

10、长江证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华下路特 8 号

法定代表人：明云成

电话：(027) 65799980

传真：(021) 33130730

联系人：任蕙

联系电话：(021) 63291352

客户服务电话：4008-888-318、027-65799883

网址：www.cz318.com.cn

11、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 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：(0755) 82493591

传真：(0755) 82493187

联系人：盛宗凌

客户服务电话：0755-25125666

网址：www.lhzq.com.cn

12、东吴证券有限责任公司

注册地址：苏州市十梓街 298 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-96288

网址：www.dwjq.com.cn

13、其他代销机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市(网点)，并另行公告。

(五) 直销机构

1、巨田基金管理有限公司深圳直销中心

地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

电话：(0755)82990365、(0755) 82993636-8608

传真：(0755)82990631

联系人：季莹

2、巨田基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市东三环北路 15 号恒安大厦 13 层

电话：(010)65951658

传真：(010)65952371

联系人：刘寅生

3、巨田基金管理有限公司上海直销中心

地址：上海市淮海中路 398 号世纪巴士大厦 20 楼

电话：(021)63851904

传真：(021)63851907

联系人：钱华

（六）注册登记机构

巨田基金管理有限公司

（七）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区光华路 1 号嘉里中心北楼 30 层

负责人：王琳

电话：(010) 65612299

传真：(010) 65610830

联系人：柯湘

联系电话：(0755) 82125006

经办律师：宋萍萍、彭晋

（八）会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所

注册地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人：蔡廷基

电话：021-53594666-2424

传真：021-62881889

联系人：黎俊文、罗永豪

联系电话：(021) 53594666-2701, 2524

经办会计师：胡琼、凌云

联系电话：(021) 53594666-2704, 2624

五、本次发行安排

（一）设立募集期限

自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

自 2004 年 2 月 23 日到 2004 年 3 月 23 日, 本基金向个人投资者与机构投资者同时发售（详见发行公告）。

根据《试点办法》的规定, 如果本基金在上述时间段内达到基金成立的法定条件, 本基金可宣布成立。

具体发行方案以发行公告为准, 请投资者就发行和购买事宜仔细阅读本基金之发行公告。

（二）募集对象

具有中华人民共和国国籍的中国公民及在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织(法律、法规、规章禁止投资于证券投资基金者除外), 及中国证监会批准的可以投资开放式证券投资基金的其他机构投资者（如 QFII）。

（三）销售场所

本基金通过销售机构办理开放式基金业务的网点公开发售, 销售机构包括:

1、直销机构: 巨田基金管理有限公司

2、代销机构: 中国光大银行、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华夏证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、长江证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司等。

3、其他代销机构: 在发行期内新增加的代销机构将另行公告。

上述销售机构办理开放式基金业务的城市（网点）的具体情况和联系方法, 请参见本基金发行公告。

（四）认购价格和费用

1、本基金的面值为每份基金单位 1.00 元。

2、认购费率：1.0%。

认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

3、认购资金利息的处理

认购资金在设立募集期所产生利息（按照银行同业存款利率）折成基金份额向投资者结算。

4、认购份额的计算

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

认购费用=认购金额×认购费率

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期利息）/基金单位面值

认购份额保留至小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归属基金资产。

例 1：某投资者在基金成立前 30 天（由于资金结算原因，起息日为 T+2，故实际享受利息为 28 天），投资 5000 元认购本基金，则其可得到的基金份额数计算如下：

认购费用=5000×1.0%=50 元

净认购金额=5000－50=4950 元

认购期利息=5000×28×（1.62%/360）=6.30 元

认购份数=（4950+6.30）/1.00=4956.30 份

即投资者投资 5000 元认购本基金，可得到 4956.30 份基金单位。

（五）基金的认购

1、认购程序：基金投资者可在设立募集期间的任一交易日到基金销售网点认购本基金，首次认购之前必须持有效证件先开立巨田基金管理有限公司基金账户和销售网点交易账户，并持银行划款单据在该销售网点填写认购申请表格，办理基金认购手续。

2、认购方式及确认：基金投资者在设立募集期内可以多次认购，已经受理的认购申请不予撤销。投资者 T 日的认购申请，销售网点核查后当场受理并出

具认购业务受理单据。投资者可于 T+2 日在原申请网点取得认购确认书或通过巨田基金管理有限公司查询认购确认信息。

3、认购限额：

(1) 在基金设立募集期内，基金投资者认购本基金的最低认购金额为 100 元；可以重复认购。

(2) 在设立募集期内出现踊跃认购行情时，基金发起人可以根据认购情况和《基金契约》的规定随时宣布结束基金认购。

六、基金成立

(一) 基金成立的条件

在设立募集期内，如本基金净认购额超过 2 亿元，且基金的基金单位认购者人数不低于 100 人，则基金发起人可依据《试点办法》及招募说明书停止发行，宣告本基金成立。

本基金成立前，投资者的认购款项只能存入基金管理人指定的商业银行中的基金认购账户，不得挪作他用。

(二) 基金设立失败

如果设立募集期满，本基金的实际募集资金不足 2 亿元或基金的基金单位认购者人数不足 100 人，则本基金不能设立。

(三) 基金不能成立时已募集资金的处理方式

本基金不能成立时，基金发起人承担全部基金募集费用，已募集的资金加计同期银行活期存款利息必须在发行期结束后 30 天内退还基金投资者。

(四) 基金存续期内基金持有人数量和资产净值的限制

本基金成立后的存续期间内，若基金的有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若基金有效持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人有权依据法律法规和《基金契约》的规定终止基金。

七、基金管理人

（一）基金管理人概述

名称：巨田基金管理有限公司

地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

成立时间：2003 年 3 月 14 日

法定代表人：王一楠

注册资本：人民币 1 亿元

（二）基金经营业绩及主要财务指标

本基金的管理公司系新成立之公司，未曾管理其他基金，尚无过往业绩可供参考。

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍

王一楠，男，现年 46 岁，硕士。1998 年至今任巨田证券有限责任公司董事长，历任国家统计局投资司副司长，华能财务公司总经理，中国华能集团副总经理。现任本公司董事长。

秦永忠，男，现年 46 岁，中央财政金融学院毕业。1997 年至今任中信国安信息产业股份有限公司总经理，历任北京国安足球集团财务部经理，中信国安总公司财务部经理，中信国安总公司综合计划部经理，中信国安信息产业股份有限公司副总经理、董事。现任本公司董事。

平建伟，男，现年 38 岁，中南财经大学毕业。2000 年至今任汉唐证券有限责任公司总裁助理，历任海南泰华期货经纪公司副总经理，广发证券有限责任公司经理。现任本公司董事。

周语菡，女，现年 34 岁，美国加州州立大学工商管理硕士。2001 年至今任招商局中国投资管理有限公司董事总经理，执行董事，历任美国 ASI 公司亚太地区业务发展主任，美国全球网联公司高级财务分析员，咨询委员会委员。现任本公司董事。

李润云，男，现年 58 岁，解放军第二外国语学院毕业。1996 年至今任浙江中大集团控股有限公司，曾就职于浙江省粮油食品进出口公司，浙江国际贸易中心，浙江外经贸委。现任本公司董事。

韩巍，男，现年 40 岁，中国人民大学档案系、法律系学士。1995 年至今任北京市信利律师事务所律师、合伙人，曾就职于国家教育委员会办公厅、中国法律事务中心。现任本公司独立董事。

荆林波，男，现年 37 岁，中国社科院研究生院经济学博士。1998 年至今任中国社科院财贸经济研究所硕士生导师。现任本公司独立董事。

何祚文，男，现年 41 岁，深圳市注协专业标准委员会委员，证券资格注册会计师，注册税务师，厦门大学工商管理硕士。2002 年至今就职于中天华正会计师事务所，曾就职于深圳华鹏会计师事务所。现任本公司独立董事。

许明，男，现年 37 岁，中南财经大学产业经济学博士。历任海南省证券公司武汉业务部副总经理，湖北中太集团有限公司总经理，三峡证券有限责任公司总裁办公室主任，研究所所长，北京营业部总经理，巨田证券有限公司北京总部副总经理，研究所副所长兼投资部总经理，巨田证券有限责任公司总经理助理，副总经理。现任本公司董事，总经理。

孙璐，男，现年 29 岁，首都经济贸易大学学士。2002 年至今任中信国安信息产业股份有限公司副总经理，历任华夏证券公司东四营业部投资部经理，中信国安有限公司总经理助理。现任本公司监事长。

卫跃丽，女，现年 36 岁，中国人民大学硕士。2002 年至今任巨田证券有限责任公司审计部副总经理，曾就职于三门峡对外贸易进出口公司，三门峡工商银行，中华财务会计咨询公司。现任本公司监事。

吕静，女，现年 40 岁，上海交通大学管理学院在读 EMBA。1999 年至今任浙江裕源投资有限公司总经理，浙江中大技术进出口集团有限公司副总经理。历任浙江华越公司财务经理，浙江技术进出口公司财务部经理。现任本公司监事。

李玉霞，女，现年 31 岁，东北财经大学会计系学士，执业注册会计师资格。1997 年至今任巨田证券有限责任公司财务部副总经理。曾就职于深圳市中诚会计师事务所。现任本公司监事。

张笑雪，女，现年 31 岁，北京大学光华管理学院、深圳证券交易所联合培养应用经济学博士后，6 年证券从业经验。历任中国国际金融有限公司研究部短期顾问、巨田证券有限责任公司研究所经理助理、巨田证券有限责任公司总经理办公室副主任。现任本公司监事。

尹军，男，现年 50 岁，中国社会科学院研究生院法学系法学硕士。8 年证券从业经验，曾任北京第二汽车制造厂办公室副主任，北京轻型汽车有限公司党委副书记，中共北京市市委研究室正处级调研员，中国证监会北京证管办处长，巨田证券有限公司副总经理。现任本公司副总经理。

刘盛，男，现年 37 岁，华南理工大学系统工程与计算机应用专业硕士。9 年证券从业经验，曾就职于长城证券，平安证券电脑部，任巨田证券有限责任公司电脑部副总经理、总经理，巨田证券有限责任公司总经理助理。现任本公司督察员。

2、本基金基金经理介绍

本公司采用团队方式进行投资管理，及通过整个投资部门全体人员的共同努力来争取良好的业绩。在投资部门内设立投资小组，每个小组在各自领域内提供投资品种和组合建议，基金经理负责决定投资组合。

管卫泽，男，36 岁，9 年证券从业经验。先后就职于深圳蓝天基金管理公司，深圳经济特区证券公司，银华基金管理有限公司，历任基金部总经理助理、投资部经理、研究发展部副总监。现任本基金基金经理。

陈忠强，35 岁，9 年证券从业经验，特许金融分析师（CFA）。先后就职于香港联合交易所，瑞典 Carlson 资产管理公司，加拿大 I.G.资产管理公司，历任研究员、投资组合经理、基金经理等职。现任本基金基金经理。

3、本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会由公司总经理、副总经理、投资管理部总监、研究发展部总监和部分从事基金投资方面的业务骨干组成，成员人数不少于 5 人。

（四）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

（1）自本基金成立之日起，根据法律、法规和《基金契约》的规定独立管理和运作基金资产；

（2）依据有关法律法规和《基金契约》的规定，获得基金管理费和其他约定和法定的收入；

（3）依照《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规及《基金契约》的规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；

(4) 依据有关法律法规及《基金契约》规定决定基金收益的分配方案；

(5) 提议召开基金持有人大会；

(6) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督。如认为基金销售代理人违反《基金契约》、《基金销售代理协议》或国家法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会或其他监管部门，并采取必要措施保护基金持有人的利益；

(7) 监督基金托管人。如认为基金托管人违反了《基金契约》或国家法律、法规有关规定，应呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金持有人的利益。除非法律法规、《基金契约》及《托管协议》另有规定，否则基金管理人对于基金托管人的行为不承担任何责任；

(8) 在基金存续期内，依据有关的法律法规和《基金契约》的规定，拒绝或暂停受理赎回申请；

(9) 在法律法规和《基金契约》的框架内，制订和调整开放式基金业务规则；

(10) 提名新的基金托管人；

(11) 选择和更换注册登记人，并对其注册登记代理行为进行监督；

(12) 基金终止时，参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(13) 以基金的名义依法为基金进行融资，并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；

(14) 基金托管人或其他第三人造成基金资产损失的，基金管理人可代表基金进行索赔；

(15) 法律、法规和《基金契约》规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 遵守《基金契约》；

(2) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产；

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

(4) 设置相应的部门，并配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回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，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(7) 除法律法规和《基金契约》另有规定外，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资产；

(8) 接受基金托管人的监督；

(9) 按规定计算并公告基金资产净值及单位基金资产净值；

(10) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》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，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(12) 本基金成立后的存续期间内，其有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或者连续 20 个工作日最低基金资产净额低于 5000 万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；

(13) 依据《基金契约》决定基金收益分配方案，并按规定向基金持有人分配基金收益；

(14) 按照有关法律法规和《基金契约》的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(16) 依据《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规和《基金契约》的规定召集基金持有人大会；

(17) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(18) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证投资者能够按照招募说明书公告的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资

料，或得到有关资料的复印件；

（19）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）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；

（21）因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金持有人进行赔偿，该过错责任不因其退任而免除；

（22）因估值错误导致基金持有人的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

（23）监督基金托管人按《基金契约》的规定履行自己的义务，因基金托管人的过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

（24）不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（25）法律、法规和《基金契约》规定的其他义务。

（五）基金管理人的更换

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，基金管理人必须更换：

（1）基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；

（2）基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益的；

（3）代表全部基金单位 50%以上（不含 50%）的基金持有人要求更换基金管理人的；

（4）中国证监会有充分理由认为基金管理人不能或不适于继续履行基金管理职责的。

2、基金管理人的更换程序

（1）提名：更换基金管理人时，由基金托管人或代表 10%或以上基金单位的基金持有人提名新任基金管理人。

（2）决议：基金持有人大会对更换基金管理人形成决议。

（3）批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准后方可继任；原任基金管理人经中国证监会批准后方可退任。

（4）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。新任基金管理人与原

基金管理人进行基金资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金管理人和基金托管人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在中国证监会批准后5个工作日内共同在至少1种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（5）基金名称变更：基金管理人更换后，如果原基金管理人要求，《基金契约》当事人应按其要求替换或删除基金名称中“巨田”的字样。

（六）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《暂行办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《暂行办法》禁止的行为发生：

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

3、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《基金契约》或《托管协议》；
- （3）故意损害基金持有人或其他基金相关机构的合法利益；

- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄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) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 故意损害基金持有人及其他同业机构、人员的合法权益；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成份；
- (15) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、本公司承诺履行诚信义务，如实披露法规要求的披露内容。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和《基金契约》的规定，本着谨慎的原则为基金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、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
 - (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) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
- (七) 基金管理人受处罚情况
- 本基金基金管理人至今未受到任何处罚。

八、基金管理人的风险管理和内部控制制度

(一) 内部控制的原则

- 1、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。

2、有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内部控制程序，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，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作必须分离。

4、相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡。

5、防火墙原则。公司研究策划、投资管理、基金交易、清算会计、信息技术等相关部门，必须在物理上和制度上适当隔离。

6、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。

（二）内部控制体系

1、内部控制系统的主体包括董事会、经营管理层、督察员、风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部、各部门和各部门业务岗位。

2、公司董事会负责决定公司内部管理机构的设置、制定公司的基本管理制度，对确保公司建立及维持适当而有效的内部控制负最终责任。

3、公司经营管理层负责设计公司的内部控制制度，拟订公司的基本管理制度和制定公司的部门业务规章，并确保公司的日常经营活动合法、合规运行。

4、各部门总监负责拟订公司的部门业务规章，并确保部门的日常业务活动合法、合规进行。

5、公司根据自身的经营特点，在经营管理层下设立顺序递进、权责统一、严密有效的控制防线。

（1）建立一线岗位自控与互控为基础的第一道监控防线。各岗位职责明确，有详细的岗位职责和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任。直接与客户、电脑、资金、有价证券、重要空白凭证、业务用章等接触的岗位，必须实行双人负责的制度。属于单人单岗处理的业务，原则上由其上级主管履行监督职责。

（2）建立部门内各子部门、部门和部门之间的自控和互控为基础的第二道防线。各部门在内部自行检查各类风险隐患，规范业务流程，完善内控措施。同时公司在相关部门之间建立合理的重要业务处理凭证传递制度与顺畅的信息传递制度，相关部门分别在授权范围内承担各自职责，并相互监督制衡。

(3) 建立监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。监察稽核部独立于其他部门和业务活动,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈,并向风险控制委员会和总经理定期与不定期报告并向督察员通报。

(4) 建立以风险控制委员会与投资决策委员会为主体的第四道防线,协助经营管理层实施对公司各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题,对监察稽核部的工作予以监督、指导。

(5) 督察员主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价;对经营管理层及四道防线中的各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和检查;对日常经营活动的合法性、合规性进行检查;并按规定独立向董事会和中国证监会报告。

(三) 内部控制制度概述

公司建立了合理、完备、有效并易于执行的内部控制制度体系。公司内部控制制度体系由不同层面的制度构成,按照其所管理的层次可以分为四个级别:

- 1、第一级别是公司章程;
- 2、第二级别是公司内部控制大纲;
- 3、第三级别是公司基本管理制度;
- 4、第四级别是公司各委员会、各部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。

以上各级别制度的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序,下一级的内容必须与上一级的内容相符。

(四) 内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

1、控制环境

包括经营理念、内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质。

2、风险评估

公司建立科学严密的风险控制评估体系,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,及时防范和化解风险。通过定期与不定期风险评估,发现风险来源和类

型，针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案，风险控制委员会批准通过后执行。

3、控制活动

主要包括授权控制、内幕交易控制、关联交易控制、法律控制和人力资源管理控制等。

4、信息沟通

建立清晰的报告制度，报告制度具体包括独立报告制度、违规报告制度和定期会议制度。独立报告制度是指监察稽核人员及时将内部控制制度的实质性缺陷或失误情况独立地向风险控制委员会和公司总经理报告的制度。违规报告制度是指公司任何员工发现已经发生的违规事件，或者预见将要发生的违规事件，应及时报告给自己的上级主管或直接报告监察稽核部。如涉及上级主管违规的，可直接报告更高一级主管、监察稽核部或风险控制委员会。定期会议制度是指风险控制委员会定期召开会议，听取监察稽核部对公司内部控制工作的汇报和建议，并于每年年终作出公司内部控制的工作总结上报经营管理层，并向督察员报告。

5、内部监控

督察员和监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制的落实。风险控制委员会与投资决策委员会必须切实协助经营管理层对公司日常业务管理活动和各类风险的总体控制，并协助解决所出现的相关问题。按照公司内部控制体系的设置，实现一线业务岗位、各部门及其子部门根据职责与授权范围的自控与互控，确保实现内部监控活动的全方位、多层次的展开。

（五）基金管理人关于内部控制的声明

本公司确定建立、实施、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

九、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国光大银行

地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：王明权

成立时间：1992 年 8 月 18 日

组织形式：股份制商业银行

注册资本：人民币 82.17 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批准文号：证监基金字【2002】75 号

2、发展概况

中国光大银行是国内第一家国有控股、国际金融组织参股的全国性商业银行。10 年来，伴随着金融业的发展，中国光大银行已具有与现代商业银行相适应的股权结构、日益完善的经营机制和布局合理的机构网络。目前，光大银行已在全国 23 个省、自治区、直辖市的 36 个经济中心城市设立了近 400 家分支机构。

3、财务状况

中国光大银行注册资本为 82.17 亿元。截止 2003 年底，总资产为 4076.86 亿元，负债为 3944.03 亿元，净资产为 132.84 亿元。2003 年度实现税前利润为 8.21 亿元。

4、基金托管部所获负责基金托管业务的授权情况

根据中国光大银行《关于设立基金托管部的通知》（光银发[2002]323 号）文，中国光大银行已于 2002 年 8 月 12 日设立了基金托管部，并同时赋予该部基金托管的责任。

（二）基金托管部的设置和员工情况

1、部门职责

主要负责全行各类基金及资产托管等业务，负责相应的制度建设，市场开拓，经营管理，营销组织和风险控制等。

2、处室设置

中国光大银行基金托管部下设制度监察处、市场开发处、业务管理处、运行管理处。

3、基金托管部员工情况

中国光大银行基金托管部现有员工 20 名，其中 50%以上人员具有海外金融

机构培训经历。

（三）主要人员情况

1、法定代表人王明权先生，历任中国人民银行武汉市分行副行长、武汉市人民政府副秘书长、武汉市人民政府副市长、交通银行副行长、党组成员、副董事长、交通银行行长、党委书记、副董事长，现任中国光大（集团）总公司董事长、总经理、党委书记、中国光大银行董事长。

2、行长王川先生，历任山西省委办公室秘书、中国农业银行农业信贷部主任、中国农业银行吉林省分行行长、中国农业银行副行长，现任中国光大（集团）总公司副董事长、中国光大银行副董事长、行长。

3、基金托管部主要负责人吴若曼女士，先后任南方证券深圳、上海分公司副总经理，蔚深证券公司副总裁、光大证券总裁助理兼基金业务部总经理，现任中国光大银行基金托管部副总经理。

4、本基金托管业务主管贾峻女士，曾在中国建设银行北京分行、中国投资银行北京分行工作，先后任中国投资银行北京分行稽核审计部副主任、财务会计部主任，中国光大银行总行营业部财务会计部总经理助理、总行私人部业务管理处处长及消费信贷处处长，现任中国光大银行基金托管部业务管理处处长。

（四）保管的其他基金名称及资产净值

目前光大银行保管着中融融华债券型证券投资基金，2004年2月13日的单位基金净值为1.1232元。

（五）受处罚的情况

近3年内，基金托管人严格按照国家相关规定运作，基金托管人及负责基金托管业务的高级管理人员没有受到过中国证监会、中国人民银行、工商行政管理局、财政税务等机关的处罚。

（六）基金托管人的内部控制制度说明

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金资产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个环节，覆盖所有的岗位，不能留有任何死角。

(2) 预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

(4) 独立性原则。基金托管业务内部控制机构必须独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和检查人员必须分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行成立了风险与内部控制管理委员会，下设办公室为具体办事机构。委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内控管理的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。基金托管部建立了严密的内控督察体系，设有稽核监督员，监督员依照法律法规和证监会的有关规定履行职责。

4、内部控制制度及措施

中国光大银行基金托管部自成立以来严格遵照《证券投资基金管理暂行办法》、《中华人民共和国商业银行法》、《开放式证券投资基金试点办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律、法规制订《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行基金托管部保密规定》等 12 项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。光大银行基金托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录象监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的绝对安全。

(七) 基金托管人的更换

1、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国银监会批准，更换基金托管人：

- (1) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；

- (2) 基金管理人认为有充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；
- (3) 代表全部基金份额 50%以上（不含 50%）的基金份额持有人要求更换基金托管人的；
- (4) 中国银监会有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

2、基金托管人的更换程序

- (1) 提名：基金管理人或代表 10%或以上基金份额的基金份额持有人提名新任基金托管人；
- (2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议；
- (3) 批准：新任基金托管人经中国证监会和中国银监会审查批准后方可继任，原任基金托管人经中国证监会和中国银监会批准后方可退任；
- (4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和中国银监会批准后 5 个工作日内公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金托管人和新任的基金管理人在批准后 5 个工作日内共同在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(八) 基金托管人禁止行为

根据《暂行办法》、《基金契约》及其他有关规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产和监督基金管理人的运作，不得从事基金投资，不得为自己或任何第三人谋取非法利益。

(九) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

- (1) 根据法律、法规和《基金契约》的规定保管基金资产，监督本基金的投资运作；
- (2) 依据《基金契约》及《托管协议》约定获得基金托管费用；
- (3) 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了《基金契约》及国家有关法律法规，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益。除非法律法规、《基金契约》及《托管协议》规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

(4) 有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行，并向中国证监会报告；

(5) 监督基金注册登记人的基金注册及过户登记服务；

(6) 法律、法规和《基金契约》规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

(1) 遵守《基金契约》；

(2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；

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

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

(5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规及《基金契约》、《托管协议》外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 以基金和基金托管人联名的方式设立证券账户、以基金的名义开立银行账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责办理基金名下的资金往来；

(8) 保守基金商业秘密。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》、《托管协议》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；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和单位基金资产净值；

(10) 采取适当、合理的措施，使基金单位的认购、申购、赎回等事项符合《基金契约》、《托管协议》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单位认购、申购、赎回价格的方法符合法律、法规、《基金契约》或其他法律文件的规定；

(12) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律、法规、

《基金契约》或其他法律文件的规定；

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

(14) 负责基金认购、申购和赎回业务的资金保管和清算；

(15) 在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金契约》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金契约》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；

(16) 按有关规定，建立并保存基金持有人名册；

(17) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

(18) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(20) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(22) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

(23) 监督基金管理人按《基金契约》的规定履行自己的义务，因基金管理人的过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规和《基金契约》规定外，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；

(24) 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(25) 法律、法规和《基金契约》规定的其他义务。

十、基金投资

基金须满足法规规定的单个基金的投资限制和禁止性规定。

(一) 投资目标

分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金持有人谋求长期、稳定的投资回报。

（二）投资理念

立足“发现价值、把握机遇、创造财富”，把握基础行业长期稳定的增长趋势，在注重控制基金资产风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

（三）投资范围

本基金的投资对象为国内证券市场依法发行上市的 A 股、债券及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的 80%。

（四）投资策略

本基金看好基础行业的发展前景，中长期持有以基础行业股票为主的证券投资组合，并注重资产在行业间的配置，适当进行时机选择。

在正常市场情况下，股票投资比例浮动范围：基金净值的 50%—75%；债券投资比例浮动范围：基金净值的 20%—45%；现金资产比例浮动范围：基金净值的 5%—20%。当市场出现极端情况，系统性风险超出正常水平时，投资比例可作一定调整，但在合理时间内，投资比例将恢复正常市场情况下的水平。

（五）选股流程及标准

在基础行业股票全样本中剔除ST等禁选股票建立基准库；用相应指标进行筛选形成备选库；运用股票综合评级系统构造投资组合。

针对基础行业特点，对上市公司进行财务状况分析、内在价值分析和相对价值分析，研究内容包括上市公司核心竞争力、持续经营能力、公司治理结构、未来经营状况和现金流、财务状况和相对价值等方面。以持续盈利和稳定增长为核心标准，对上市公司进行分行业综合评级，立足于发现具有长期投资价值的上市公司，进而根据行业配置要求构造投资组合。

（六）业绩比较基准

上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信全债指数×20%+同业存款利率×5%

复合指数=（上证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×上证综指+（深证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×深证综指

（七）风险收益特征

2000 年以来的模拟分析结果显示，基础行业模拟组合长期收益优于比较基

准，BETA 值、标准差等风险指标小于比较基准，具有良好的风险收益特征。

（八）投资决策

1、决策依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- （1）国家有关法律、法规和《基金契约》的有关规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；
- （3）国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；
- （4）各行业、地区发展状况；
- （5）上市公司财务状况、行业处境、经济和市场的需求状况及其当前市场价格；
- （6）证券市场资金供求状况及未来走势。

2、投资流程

（1）研究发展部提出市场策略研究报告和宏观经济、行业、上市公司分析报告。

研究员在广泛参考和利用公司外部的研究成果，尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告，并经常走访上市公司，拜访国家有关部委，了解国家宏观经济政策及行业发展状况的基础上，经过筛选、归纳和整理，定期或不定期地撰写市场策略研究报告和宏观经济分析报告、行业分析报告、上市公司分析报告。

研究发展部向投资决策委员会和投资管理部提供研究报告，作为其投资决策依据。

（2）投资决策委员会决议确定本基金资产分配比例

投资决策委员会根据基金经理提供的策略分析报告和研究发展部提供的研究报告，决议确定基金资产的股票、债券、现金分配比例和总体投资计划。

（3）基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案

基金经理小组根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划，参考研究发展部的宏观、行业、企业及市场分析报告，制定投资仓位以及具体的资产分配比例，选择行业和个股，构造投资组合方案。

（4）基金投资组合方案经投资决策委员会审核后，由基金经理向集中交易

室下达具体交易指令。

(5) 风险控制委员会提出风险控制建议

风险控制委员会根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督,投资计划执行完毕,本基金经理小组负责向投资决策委员会提出总结报告。

(6) 本基金管理人在确保基金持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资流程。

(九) 投资限制

禁止从事下列行为:

- 1、投资于其他基金;
- 2、以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券;
- 3、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款;
- 4、以基金资产进行房地产投资;
- 5、从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
- 6、从事证券信用交易;
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司所发行的证券;
- 8、内幕交易、操纵市场、通过关联交易损害基金持有人的利益;
- 9、配合基金管理人的发起人及其他任何机构的证券投资业务;
- 10、故意维持或抬高基金管理人的发起人及其他任何机构所承销股票的价格;
- 11、中国证监会禁止从事的其他行为。

(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利,保护基金持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东权利时应遵守以下原则:

- 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、有利于本基金资产的安全和增值;
- 3、独立行使股东权利,保护基金持有人的利益;
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使股东权利。

十一、风险揭示

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金资产构成潜在风险，导致基金收益水平发生波动。风险因素主要存在以下几种：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于国债与上市公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，同时也影响到证券市场资金供求关系，并在一定程度上影响上市公司的盈利水平，上述变化将直接影响本基金的收益。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化分散这种非系统性风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

6、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

本基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响

基金收益水平。

7、流动性风险

本基金类型为契约型开放式，基金规模将随着基金投资者对基金单位的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售股票债券，使基金资产净值受到不利影响，从而产生流动性风险。

8、其他风险

(1) 因技术因素而产生的风险，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术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；

(2) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

(4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 因业务竞争压力可能产生的风险；

(6) 其他风险。

十二、基金费用

(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、证券交易费用；
- 4、基金信息披露费用；
- 5、基金持有人大会费用；
- 6、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它费用。

(二) 基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前 1 日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。

具体计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ ；

H 为每日应付的基金管理费；

E 为前 1 日的基金资产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前 1 日基金资产净值的 2.5% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$ ；

H 为每日应支付的基金托管费；

E 为前 1 日的基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

3、上述“（一）基金费用”中第 3—7 项费用由基金托管人根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，由基金托管人从基金资产中支付。基金成立前的验资费、律师费、《基金契约》、招募说明书、发行公告等信息披露费用由基金管理人承担。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（四）基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

十三、基金资产

（一）基金资产总值

基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收基金申购款及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金资产的账户

本基金的专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人自有的资产账户以及其它基金资产账户相互独立。

（四）基金资产的处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人、销售代理人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、销售代理人以其自有的资产承担法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。

除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

十四、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的单位基金资产净值，是计算基金申购与赎回的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为基金相关的证券交易场所的正常营业日，定价时点为交易场所的收市时间。

（三）估值对象

本基金按照《证券投资基金会计核算办法》的估值原则，以及《基金契约》和招募说明书载明的估值事项对基金所拥有的股票、债券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产进行估值。

（四）估值方法

1、上市流通的有价证券按估值日的收盘价计算；该日无交易的证券，以最近1个交易日的收盘价计算；

2、未上市的股票分两种情况：未上市流通的属于增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价计算，该日无交易的，以最近1日的收盘价计算；未上市流通的属于首次公开发行的股票以其成本价估值；

3、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；

4、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；

5、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收债券利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

6、银行间债券市场债券按购入成本加计持有期利息估值；

7、债券利息收入、存款利息收入、买入返售证券收入、股利收入等收入的确认都采用权责发生制原则；

8、未上市国债及银行存款，以本金加计至估值日止应计利息额计算；

9、未上市的其它证券以其成本价计算；

10、派发的股息红利、债券利息以除权日为止的应获得额计算；

11、如遇特殊情况而无法或不宜以上述方法确定资产价值时，或有确凿证据表明按上述方法不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。若基金管理人坚持采用前款规定对基金资产估值，仍应被认为采用了适当的估值方法；

12、如国家对证券投资基金资产估值方法的新增规定或变更事项，按国家最新规定估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产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《基金契约》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字返回给基金管理人；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）估值差错的处理

单位基金资产净值的计算采用四舍五入方法保留到小数点后4位。当基金资产的估值导致单位基金资产净值小数点后4位以内发生差错时，视为基金资产估值错误。

基金管理人、基金托管人和注册登记人应采取必要、适当、合理的措施确保

基金资产估值的准确性和及时性。当发生估值错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值错误偏差达到基金资产净值 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金管理人的过错导致单位基金资产净值计算错误给基金持有人造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿原则如下：

1、赔偿仅限于因差错而导致的直接损失；且仅赔偿在单次交易中给单一当事人造成 10 元以上的损失。

2、基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；

3、计算的基金单位资产净值低于正确的基金单位资产净值时的处理：

（1）申购确认份额大于实际应确认份额，由基金管理人向投资者追偿少付的申购金额，不能追偿的由基金管理人赔付给基金资产；

（2）赎回确认金额小于实际应确认金额，不足部分由基金管理人赔付给投资者。

4、计算的基金单位资产净值高于正确的基金单位资产净值时的处理：

（1）申购确认份额小于实际应确认份额，少计基金份额部分的申购资金由基金管理人退还给投资者；

（2）赎回确认金额大于实际应确认金额，多付部分由基金管理人赔付给基金资产。

5、差错期间因差错造成的基金管理人的策略性错误，如巨额赎回比例确定，均以当日决定为准，不予纠正。

6、因基金管理人以外的第三人的过错导致单位基金资产净值计算错误给基金资产或投资者造成损失的，基金管理人在赔偿投资者或基金的损失后有权向其追偿。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资涉及的证券交易所因法定节假日或其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

（八）特殊情形的处理

1、如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化造成的误差，不作为基金单位净值错误处理。

2、基金管理人按估值方法中的第 11 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。

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

十五、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。

十六、基金收益和分配

（一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、国债利息；
- 2、买卖证券的价差收入；
- 3、银行存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

（二）基金净收益

计算期基金净收益为基金本期收益扣除本期基金管理费、基金托管费等基金运作过程中发生的各项费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于当年基金净收益的 90%；
- 2、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日经除权后的单位基金资产净值自动转为基金单位进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是红利再投资；
- 3、在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次，基金成立不满 3 个月，则可不进行收益分配；

- 4、基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 6、每一基金单位享有同等收益分配权；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，按规定执行。

（四）收益分配方案

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配方案的确定与公告

本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，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

十七、基金的会计和审计

（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；如果基金成立至 12 月 31 日之间少于 3 个月，可以并入下 1 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、基金会计核算按《证券投资基金会计核算办法》执行；
- 5、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；
- 6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请会计师事务所对基金年度财务报表进行审计。会计师事务所与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计

师事务所在 5 个工作日内公告。

十八、基金申购、赎回

（一）申购、赎回的场所

本基金成立后，基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点（具体名单见发行公告）进行。待条件成熟后，基金管理人可指定其他具有相应条件的基金销售代理人办理基金申购与赎回业务。同时，在国内的电子支付与结算和其他相关技术成熟后，基金持有人可通过本基金管理人或者指定的基金销售代理人进行电话、传真或互联网等形式的申购与赎回。

（二）申购、赎回开放日及开放时间

本基金成立后将根据《暂行办法》、《试点办法》及有关规定封闭运作 30 个工作日，此期间暂不办理赎回，但可以申购；封闭期后，持有人可以在正常工作日到指定的地点进行申购、赎回。具体业务办理时间基金管理人应在申购、赎回开放日前 3 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

申购、赎回的开放日为证券交易所的正常交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及其他证券交易场所交易日的交易时间。

申购开始日：基金宣布成立后的第一个开放日。

赎回开始日：封闭期结束后的第一个开放日。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，基金管理人可视情况对营业时间进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

（三）申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金申购与赎回以申请当日的单位基金资产净值为基准进行交易；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即本基金申购以金额申请，基金赎回以基金单位份额申请；

3、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销；

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况在不损害基金持有人利益的前提下更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日的 3 个工作日前在至少 1

种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

（四）申购和赎回的程序

1、申请方式：书面申请或销售人公布的其他方式。

2、申购、赎回的确认与通知：T 日提交的有效申请，本基金注册登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售人规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

3、申购、赎回款项的支付：基金申购采用全额缴款方式。基金持有人赎回申请确认后，赎回款项在 T+6 日内支付。在发生延期支付的情形时，款项和份额的支付办法参照《基金契约》的有关条款处理。

4、T 日的基金单位资产净值在当天收市后计算，并于次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（五）申购与赎回的数额限制

1、代销网点每个账户每次申购的最低金额为 100 元；

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 1 万元，已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，追加申购的最低金额为 100 元；

3、赎回的最低份额为 100 份基金单位，基金持有人可将其全部或部分基金单位赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金单位余额少于 100 份时，余额部分基金单位必须一同赎回；

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前 3 个工作日至少在 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告并报中国证监会备案；

5、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，除以当日基金单位资产净值为基准计算的申购价格，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归属基金资产；

6、净赎回金额的处理方式：净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金单位资产净值为基准计算的赎回价格并扣除相应的费用，以四舍五入方式保留到小数点后两位。

（六）申购与赎回费用

1、本基金的申购费率：1.5%

本基金的申购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、本基金的赎回费率：0.5%。

本基金的赎回费用 60%用于支付相关手续费和注册登记费用，40%归属基金资产，作为对其他持有人的补偿。

3、经报中国证监会批准，基金管理人可以在《基金契约》规定的范围内调整本基金的申购和赎回费率，调整结果将至少提前 3 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上公告，如果调高申购、赎回费率须经基金持有人大会通过。

（七）申购份额与净赎回金额的计算

1、申购份额的计算

申购份额为申购金额减去申购费用后除以以当日的基金单位资产净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，基金单位份额保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分归属基金资产。

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

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

申购价格 = 申购日单位基金资产净值

申购份额 = 净申购金额 / 申购价格

例 2：某投资者在基金存续期间投资 50000 元申购本基金，该日基金单位净值为 1.0800 元，则其可得到的申购份数计算如下：

申购费用 = $50000 \times 1.5\% = 750$ 元

净申购金额 = $50000 - 750 = 49250$ 元

申购份额 = $49250 / 1.0800 = 45601.85$ 份

即投资者投资 50000 元申购本基金，可得到 45601.85 份基金单位。

2、净赎回金额的计算

净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以以当日的基金单位资产净值为基准计算的赎回价格减去赎回费用，净赎回金额单位为元，保留到小数点后两位，小数点两位以后四舍五入。计算公式如下：

赎回金额=赎回份数×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

赎回价格=申请日单位基金资产净值

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例 3: 假定某投资者在 T 日赎回 10000 份基金单位, 持有时间为 5 个月, 该日基金单位净值为 1.2500 元, 则其获得的净赎回金额计算如下:

赎回金额=10000×1.250=12500 元

赎回费用=12500×0.5%=62.50 元

净赎回金额=12500-62.50=12437.50 元

T 日的基金单位净值在当天收市后计算, 并于次日公告。遇特殊情况, 可以适当延迟计算或公告, 并报中国证监会备案。

(八) 申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后, 注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续, 投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金单位。

投资者赎回基金成功后, 注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内, 对上述注册登记办理时间进行调整, 并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(九) 暂停或拒绝申购、赎回的情形和处理方式

1、在如下情况下, 基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

(1) 不可抗力导致基金无法正常运转;

(2) 证券交易场所交易时间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) 基金资产规模过大, 可能对基金业绩产生负面影响并损害基金持有人的利益, 或基金管理人认为无法找到合适的投资机会;

(4) 基金管理人认为会有损于已有基金持有人利益的其他申购;

(5) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

2、在如下情况下, 基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请:

- (1) 不可抗力导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易所非正常停市或者其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因，基金连续两个开放日及以上发生巨额赎回或在 10 个工作日内发生 3 次及以上巨额赎回；
- (4) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户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兑付，并以后续开放日的基金单位净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日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。

发生《基金契约》、招募说明书或公开说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有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者的申购、赎回申请。

暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人将于重新开放日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露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单位净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 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 1 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露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单位净值。

如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告 1 次；暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露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单位净值。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请（有效赎回申请总份额扣除有效申购申请总份额后的余额）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接受全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

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

（2）部分延期赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10% 的前提下，可以对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理，但基金持有人可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销；转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金单位净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者《基金契约》、《招募说明书》规定的其他方式、在规定的时间内通知基金持有人，说明有关处理方法。同时在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上公告，通知投资者，并说明有关处理方法；通知和公告的时间最长不得超过 3 个证券交易所交易日。

（3）暂停赎回：基金连续 2 个开放日及以上发生巨额赎回，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期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

十九、基金持有人的权利、义务和相关服务

基金投资者购买本基金单位的行为即视为对《基金契约》的承认和接受，基金投资者自取得依据本基金契约发行的基金单位，即成为基金持有人和《基金契约》的当事人。基金持有人作为当事人并不以在《基金契约》上的书面签章为必

要条件。

（一）基金持有人的权利和义务

1、基金持有人的权利

（1）按照《基金契约》的规定提议召开或自行召开及出席或者委派代表出席基金持有人大会，并行使表决权；

（2）分享基金财产收益；

（3）监督基金运作情况，按《基金契约》的规定查询或者获取公开的基金业务及财务状况资料；

（4）按《基金契约》的规定享有申购或赎回基金份额及其他对基金份额处分的权利，并在规定时间内取得有效申请的款项或基金份额；

（5）取得基金清算后的剩余资产；

（6）知悉《基金契约》规定的有关信息披露内容；

（7）提请基金管理人或基金托管人履行按本契约规定应尽的义务；

（8）因基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构的过错导致合法权益受到损害时，有依法提起诉讼的权利；

（9）法律法规及《基金契约》规定的其他权利。

2、基金持有人的义务

（1）遵守《基金契约》及相关业务规则；

（2）缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；

（3）在所持有的基金份额范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

（5）法律法规及《基金契约》规定的其他义务。

（二）基金持有人大会

基金持有人大会由基金持有人或基金持有人合法的授权代表共同组成。

1、召开事由

有以下情形之一的，应召开基金持有人大会：

（1）修改《基金契约》，但本《基金契约》另有规定的除外；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

- (4) 决定终止基金；
- (5) 与其他基金合并；
- (6) 法律、法规、《基金契约》和中国证监会规定的其他情形。

2、召集方式

(1) 正常情况下，基金持有人大会由基金管理人召集，基金持有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定；

(2) 在更换基金管理人、审议与基金管理人利益冲突的事项或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集；

(3) 在单独或合计持有基金总份额 10%或以上的基金持有人就同一事由要求召开基金持有人大会的情形下，该部分持有人应向基金管理人和基金托管人提交书面要求；如果基金管理人和基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并报中国证监会备案。

3、通知

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

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

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

4、开会方式

开会方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方

式召开基金持有人大会。

(1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金持有人大会。

出席会议的基金持有人或其授权代表所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%或以上的，基金持有人会议可以召开。

(2) 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。召集人收到的出具书面表决意见书的基金持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%或以上的，通讯方式开会有效。召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金持有人的书面表决意见。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金持有人利益的重大事项，如修改《基金契约》、决定终止基金、转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及召集人认为需提交基金持有人大会讨论的其他事项。

基金持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

基金持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，不得再提出会议通知中未列出事项的新提案，对原有提案的修改应当在基金持有人大会召开日前 10 天公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持权益登记日基金总份额 10%或以上的基金持有人可以在会议通知发出后向大会召集人提交会议通知中所列出事项的临时提案，临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。

召集人对于基金管理人和基金托管人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

对于基金持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性。大会召集人对于基金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《基金契约》规定的基金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，不提交基金持有人大会审议。如果召集人决

定不将基金持有人提案提交大会表决，应当在该次基金持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对基金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持有人大会作出决定，并按照基金持有人大会决定的程序进行审议。

（2）议事程序

①现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照本条第（七）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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持有人以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）选举产生 1 名基金持有人作为该次基金持有人大会的主持人。

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、持有或者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

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前 20 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

6、表决

（1）基金持有人所持每份基金份额有一票表决权。

（2）在现场开会之情形下，亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、《基金契约》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

（3）在通讯开会之情形下，直接出具书面意见的基金持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出

具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、《基金契约》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(4) 基金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持有人所持表决权的半数以上（不含半数）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持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(5) 基金持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

(7) 基金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。

7、计票

(1) 现场开会

①如基金持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金持有人中选举两名基金持有人代表与大会召集人授权的 1 名监督员共同担任监票人；如大会由基金持有人自行召集，基金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持有人中选举 3 名基金持有人代表担任监票人。

②监票人应当在基金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，而出出席会议的基金持有人或者基金持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，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。

(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的监督下进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

8、生效与公告

基金持有人大会决议自作出之日起生效，但其中需中国证监会或其他有权机构批准的，自批准之日或相关批准另行确定的日期起生效。

生效的基金持有人大会决议对全体基金持有人均有法律约束力。

基金持有人大会决议自生效之日起5个工作日内在至少1种指定媒体予以公告。

（三）基金持有人的服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

1、基金持有人投资交易确认服务

注册登记人保留基金持有人名册上列明的所有基金持有人的基金投资记录。

基金管理人直销中心应根据在基金管理人直销中心进行交易的投资者的要求提交成交确认单。基金销售代理人应根据在代销网点进行交易的投资者的要求提交成交确认单。

2、基金持有人交易记录查询服务

本基金持有人可通过基金管理人的客户服务中心、本公司网站查询历史交易记录。

3、基金持有人交易对账单寄送服务

基金管理人根据投资者需要向投资者提供交易对账单。原则上对账单一年至少发送一次，以书面或电子文件形式发送。

4、定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用代理销售网点或直销网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金单位，具体实施方法另行公告。

5、资讯服务

投资者可通过如下方式了解认购、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。

(1) 客户服务中心电话：400-8888-668

(2) 互联网站及电子信箱

网址：<http://www.jtfund.com>

电子信箱：jutian@jtfund.com

二十、基金的信息披露

本基金的信息披露将严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《证券投资基金信息披露指引》、《证券投资基金信息披露编报规则》、《基金契约》及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将固定在至少 1 种中国证监会指定的媒体上公告。

(一) 信息披露的内容及时间

1、招募说明书

本基金发起人按照《暂行办法》、《试点办法》编制并公告招募说明书。

2、发行公告

基金管理人将按照《暂行办法》、《试点办法》和本《基金契约》编制并发布发行公告。

3、开放申购/赎回业务公告

基金管理人将按照《基金契约》的有关规定发布开放申购/赎回业务公告。

4、定期报告

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照《暂行办法》、《试点办法》的规定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进行编制，包括年度报告、半年度报告、投资组合公告、基金资产净值公告及公开说明书，并在指定媒体公告，同时报中国证监会备案。

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

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

(3) 基金投资组合公告：每季度公告 1 次，于截止日后 15 个工作日内公告。

(4) 基金资产净值公告：每个开放日的次日公布该日的基金单位资产净值。

(5) 公开说明书：

本基金成立后，基金管理人每 6 个月结束后的 30 日内公告公开说明书，并应在公告时间 15 日前报中国证监会审核。公开说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后一日。

5、临时报告与公告

本基金在运作过程中发生下列可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事项之一时，基金管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- (1) 基金持有人大会决议；
- (2) 基金管理人或基金托管人变更；
- (3) 基金管理人或基金托管人的董事、监事和高级管理人员变动；
- (4) 基金管理人的董事一年内变更超过 50%；
- (5) 基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更达 30%以上；
- (6) 基金经理更换；
- (7) 重大关联交易；
- (8) 基金管理人或基金托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- (9) 重大诉讼或仲裁事项；
- (10) 基金终止；
- (11) 基金发生巨额赎回并顺延支付；
- (12) 基金暂停申购和赎回；
- (13) 其他重大事项。

(二) 澄清公告与说明

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金持有人的收益预期产生误导性影响或引起较大恐慌时，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(三) 信息披露文件的存放与查阅

本基金信息披露事项将刊登在中国证监会指定的信息披露报刊上。本基金管理人和基金托管人指定专人负责信息管理工作。

基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向

基金管理人出具书面文件。

本基金年度报告、中期报告、临时公告、基金资产净值公告、基金投资组合公告等公告文本存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内投资者可免费查阅，亦可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十一、基金终止

本基金有下列情形之一的，基金终止：

（一）在基金的存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元，基金管理人依照法律法规及《基金契约》的规定终止基金。

（二）持有人大会表决提前终止的；

（三）因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

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

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

（六）中国证监会规定的其他终止事由。

二十二、基金清算

（一）基金清算小组

1、自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组必须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发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

（二）基金清算程序

- 1、本基金终止后，发布基金清算公告；
- 2、由基金清算小组统一接管基金资产，其他任何人不得处理和处置；
- 3、对基金资产进行清理、核查和确认；
- 4、对基金资产进行估值；
- 5、对基金资产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、公布基金清算结果公告；
- 8、进行基金剩余资产的分配。

（三）清算费用

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

（四）基金剩余资产的分配

基金清算后，基金资产按下列顺序清偿：

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

（五）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项应及时公告；基金清算结果由基金清算小组报经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

（六）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存 15 年以上。

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

二十四、备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

- （一）中国证监会批准基金设立的文件
- （二）《基金契约》
- （三）法律意见书
- （四）基金发起人的营业执照
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件。

巨田基金管理有限公司

2004 年 2 月