

巨田基础行业证券投资基金

招募说明书（更新）

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

巨田基础行业证券投资基金（以下简称“本基金”）于2004年2月3日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]11号文核准公开发行。本基金的基金合同于2004年3月26日正式生效。本基金为契约型开放式。

本基金的基金合同已经根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关规定进行修订。修订后的基金合同已于2004年10月20日开始生效，修订后的基金合同全文已登载于本基金管理人网站。

本基金管理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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2004年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2004年9月30日(财务数据未经审计)。

目 录

一、绪言	1
二、释义	1
三、基金管理人	3
四、基金托管人	10
五、相关服务机构	13
六、基金的募集	19
七、基金合同的生效	19
八、基金份额的申购与赎回	19
九、基金的投资	25
十、基金的业绩	30
十一、基金的财产	30
十二、基金资产的估值	31
十三、基金的收益分配	34
十四、基金的费用与税收	35
十五、基金的会计与审计	37
十六、基金的信息披露	38
十七、风险揭示	41
十八、基金的终止与清算	43
十九、基金合同的内容摘要	44
二十、基金托管协议的内容摘要	55
二十一、对基金份额持有人的服务	62
二十二、其他应披露事项	63
二十三、招募说明书的存放及查阅方式	63
二十四、备查文件	64

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法规以及《巨田基础行业证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对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

基金或本基金	指巨田基础行业证券投资基金
基金合同	指《巨田基础行业证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
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》及其更新
发售公告	指《巨田基础行业证券投资基金发售公告》
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
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其作出的修订
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基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

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、基金份额注册登记、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
基金份额持有人	指依法或依基金合同、招募说明书取得基金份额的投资者
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）。
基金合同生效日	指 2004 年 3 月 26 日
基金终止日	指基金合同规定的基金终止事由出现后按照基金合同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认购截止日的时间段，最长不超过 3 个月
存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期限
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
申购	指基金合同生效后，投资者通过销售人向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
基金账户	指注册登记人为基金份额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份额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本基金基金份额引起的份额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份额净值的过程
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刊、互联网网站及其他媒体
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、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：巨田基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

办公地址：广东省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：1 亿元人民币

电话：（0755）82993636

联系人：李锦

本基金管理人是经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立。公司股东为：巨田证券有限责任公司（35%）、中信国安信息产业股份有限公司（35%）、汉唐证券有限责任公司（15%）、深圳市招融投资控股有限公司（10%）、浙江中

大集团控股有限公司（5%）。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

王一楠先生，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。

秦永忠先生，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。

平建伟先生，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。

周语菡女士，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。

李润云先生，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。

韩巍先生，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。

荆林波先生，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。

何祚文先生，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。

许明先生，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。

2、基金管理人监事会成员

孙璐先生，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。

卫跃丽女士，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。

吕静女士，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。

李玉霞女士，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。

张笑雪女士，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。

3、公司高管人员

许明先生，总经理，简历同上。

尹军先生，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。

刘盛先生，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。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

管卫泽：投资总监、基金经理，37 岁，硕士研究生，浙江大学证券与期货贸易专业毕业，10 年证券从业经验。曾服务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；曾任基金部总经理助理、研究部副总监、投资部经理。

陈忠强：基金经理，36 岁，理学学士，香港中文大学主修统计学，特许金融分析师(CFA)，10 年证券从业经验。先后服务于香港联合交易所、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。

5、投资决策委员会成员

许明先生，本公司董事、总经理、投委会主席

管卫泽先生，投资管理部总监兼基金经理、投委会委员

赵昱东先生，研究发展部总监、投委会委员

张笑雪女士，投委会委员

陈忠强先生，基金经理、投委会委员

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、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、编制半年度和年度基金报告；

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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》行为的发生；

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺防止以下禁止行为的发生：

- （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，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

5、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、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）基金管理人的内部控制制度

1、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。

2、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、督察长、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长通报。

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督察长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。

3、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。

4、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，并向督察长报告。

（5）内部监控

督察长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。

5、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。

四、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

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：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

注册资本：82.17 亿元人民币

电话：(010) 68560675

联系人：张建春

2、主要人员情况

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。

行长郭友先生，历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任，国家外汇管理局中国投资公司（新加坡）副总经理，中国人民银行外资金机构管理司副司长，中国光大银行副行长，中国光大（集团）总公司党组成员兼中国光大控股有限公司行政总裁，中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理、党委委员兼中国光大控股有限公司行政总裁，现任中国光大（集团）总公司副董事长、党委委员、中国光大银行党委副书记、行长。

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。

本基金托管业务主管林虹女士，曾供职于国家审计署金融审计司、中国工商银行基金托管部，现任中国光大银行基金托管部业务管理处副处长。

信息披露人张建春先生，曾供职于河北财经学院、中国建设银行总行基金托管部，现任中国光大银行基金托管部风险管理处处长。

3、基金托管业务经营情况

截止 2004 年 9 月 30 日，我行共托管中融融华债券基金、巨田基础行业基金、中融景气行业基金、泰信先行策略基金和光大保德信量化核心基金 5 只证券投资

基金、2 笔委托资产。托管资金规模 82.48 亿元，其中：证券投资基金 80.18 亿元，委托资产 2.3 亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

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，新设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

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、完善了《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》等十余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，以保障基金信息的安全。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金管理人运作基金进行监督。

围绕主要业务环节和内容，监督的方法和程序主要有：

1、通过技术系统，设置基金投资相关参数，对基金投资组合、投资比例、禁止投资品种等每日进行监督。一旦出现违反规定的投资，系统自动预警，托管人立即通过电话、书面提示等方式要求改正或上报监管机构。

2、通过系统和人工结合的方式，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人 and 基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。对因基金管理人的过错导致基金资产减损、或处于危险状态的，立即以书面的方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。包括要求基金管理人赔偿损失。

3、事先审核管理人的投资计划，例如对基金场外交易，要求管理人事先传递新股申购计划，结合技术系统进行监督，发现问题，及时纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、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：刘尔宁

（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）53066676

传真：（021）53068850

联系人：柴阳

2、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）68560675

传真：（010）68560661

联系人：张建春

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：黄健

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：王志伟

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）63296362

传真：(021) 33130730

联系人：甘露

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) 82493561

传真：(0755) 82493187

联系人：盛宗凌

客户服务电话：400-8888-5555，(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) 北京证券有限责任公司

注册地址：北京海淀区车公庄西路乙 19 号华通大厦 B 座 10 层

法定代表人：凌新源

电话：(010) 68431166

传真：(010) 88018657

联系人：白源

客户服务电话：(010) 68431166-8009

网址：<http://www.bjzq.com.cn>

(14) 山西证券有限责任公司

注册地址：太原市迎泽大街 282 号

电话：(0351) 8686888

联系人：刘文康

客户服务电话：(0351) 8686888

网址：www.i618.com.cn

(15) 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

法定代表人：朱利

电话：(010) 66568587

联系人：郭京华

客户服务电话：800-820-1868

网址：http://www.chinastock.com.cn

3、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。

(二) 注册登记机构

名称：巨田基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

办公地址：广东省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

电话：(0755) 82993636

联系人：李锦

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区光华路 1 号嘉里中心北楼 30 层

办公地址：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

联系人：柯湘

经办律师：宋萍萍、彭晋

（四）审计基金财产的会计师事务所

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

办公地址：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

联系人：黎俊文、罗永豪

经办会计师：胡琼、凌云

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照有关法律法规和基金合同募集，基金募集申请经中国证监会于 2004 年 2 月 3 日核准，核准文件名称为证监基金字[2004]11 号文。

本基金募集期为 2004 年 2 月 23 日至 2004 年 3 月 23 日。经深圳天健信德会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，设立募集期共募集 1,854,893,478.59 份基金份额，有效认购户数为 17,274 户。

七、基金合同的生效

本基金合同已于 2004 年 3 月 26 日生效。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

投资者应当在销售机构办理开放式基金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。本基金的销售机构包括巨田基金管理有限公司及其委托的代销机构。目前的代销机构包括中国光大银行、国泰君安证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、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、北京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司。

巨田基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

（二）申购、赎回开放日及开放时间

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：2004 年 4 月 1 日。

赎回开始日：2004 年 5 月 14 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。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

（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基金份额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份额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两日前在至少 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。基金份额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，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

（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，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，余额部分基金份额必须一同赎回；

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两日至少在 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；

（六）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份额净值为基准计算的申购价格，基金份额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。

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 = 申购日基金份额净值

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，该日基金份额净值为 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 份基金份额。

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份额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，以四舍五入方式保留到小数点后两位。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=申请日基金份额净值

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 份基金份额，持有时间为 5 个月，该日基金份额净值为 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

3、基金份额净值的计算

T 日基金份额净值=T 日收市后基金资产净值/T 日基金份额余额。

T 日的基金份额净值采用四舍五入方法保留到小数点后 4 位，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。

（七）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份额。

投资者赎回基金份额成功后，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两日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（八）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) 不可抗力原因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份额持有人的利益，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份额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转；
- (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份额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。

发生基金合同、招募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份额净值。

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份额净值。

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，基金管理人应提前两日在至少 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份额净值。

（九）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，但基金份额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份额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、传真或者基金合同、招募说明书规定的其他方式、在规定的时间内通知基金份额持有人，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两日。

（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。

九、基金的投资

（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，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

（二）投资方向

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%。

（三）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。

1、资产配置

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。

2、选股流程及标准

选股流程为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。

选股的标准主要是针对基础行业特点，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。

3、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份额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。

(四) 业绩比较基准

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

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

基准指数的构建考虑了三个原则:

1、由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

2、投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

3、业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

（五）投资限制

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。

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份额持有人的利益；
- 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。

（六）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东权利时应遵守以下原则及方法：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权益，保护基金份额持有人的利益；
- 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。

（七）基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行根据本基金合同规定，于 2004 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

1、期末基金资产组合情况

资产名称	金额	占基金资产总值比例
股票	1,180,816,032.41	53.68%
债券	597,095,906.81	27.14%
银行存款和清算备付金	414,627,614.64	18.85%
其它资产	7,256,848.52	0.33%
基金资产总计	2,199,796,402.38	100.00%

2、期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	期末股票市值	占净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	189,329,856.80	8.82%
C 制造业	217,194,722.40	10.12%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	8,415,629.43	0.39%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	140,877,407.50	6.56%
C7 机械、设备、仪表	67,901,685.47	3.16%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	308,964,250.45	14.39%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	442,957,615.20	20.64%
G 信息技术业	11,690,867.92	0.54%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	0.00	0.00%

J 房地产业	0.00	0.00%
K 社会服务业	10,678,719.64	0.50%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,180,816,032.41	55.01%

3、基金投资前十名股票明细

股票代码	股票名称	库存数量	期末市值	市值占净值比例
000039	中集集团	6,141,125	140,877,407.50	6.56%
600026	中海发展	13,643,681	133,162,326.56	6.20%
600900	长江电力	10,416,077	90,932,352.21	4.24%
600009	上海机场	6,011,056	84,996,331.84	3.96%
600011	华能国际	9,378,728	83,939,615.60	3.91%
000089	深圳机场	5,902,549	60,619,178.23	2.82%
600188	兖州煤业	4,304,386	60,132,272.42	2.80%
000956	中原油气	5,708,441	54,629,780.37	2.55%
600018	上港集箱	3,405,673	50,744,527.70	2.36%
000027	深能源 A	5,282,665	49,392,917.75	2.30%

4、期末按券种分类的债券投资组合

券种	期末市值	市值占净值比例
国债	280,497,875.10	13.07%
金融债	98,610,000.00	4.59%
企业债	100,000,000.00	4.66%
可转债	117,988,031.71	5.50%
合计	597,095,906.81	27.82%

注：金融债为可计入国家债券投资的国家政策性银行发行的债券：04 国开 07。

5、基金投资前五名债券明细

债券名称	期末市值	市值占净值比例
04 国债（5）	129,218,715.20	6.02%
04 国债（1）	101,279,159.90	4.72%
04 中信国安债	100,000,000.00	4.66%
04 国开 07	98,610,000.00	4.59%
04 国债（2）	50,000,000.00	2.33%

6、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体并没有被监管部门立案调

查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产的构成

序号	资产科目名称	金额
1	交易保证金	936,191.30
2	应收利息	6,151,138.72
3	应收申购款	169,518.50
合计		7,256,848.52

(4) 持有的处于转股期的可转换债券明细

可转债代码	可转债名称	期末市值	市值占净值%
126301	丝绸转 2	6,081,848.40	0.28%

十、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效以来至 2004 年 9 月 30 日，本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较表：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.98%	0.98%	3.90%	1.53%	0.08%	-0.55%
过去三个月	4.66%	0.76%	0.29%	1.15%	4.38%	-0.39%
自基金合同生效 起至今	-2.14%	0.64%	-15.75%	1.04%	13.61%	-0.40%

十一、基金的财产

(一) 基金财产的构成

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、其它投资及其估值调整；
- 9、其它资产等。

（二）基金财产的账户

基金托管人以托管人和基金联名的方式开设的证券账户、以基金名义开立的银行账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售服务代理人、注册登记人自有资产账户以及其他基金财产账户相独立。

（三）基金财产的保管与处分

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

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

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十二、基金资产的估值

（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基金份额净值，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，以及基金合同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

基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位。当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 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基金份额净值计算错误给基金份额持有人造成损失的，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、计算的基金份额净值低于正确的基金份额净值时的处理：

（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、计算的基金份额净值高于正确的基金份额净值时的处理：

（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基金份额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，不作为基金份额净值错误处理。

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。

十三、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 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，投资者可事先选择将所获分配的现金收益按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

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，基金合同生效不满 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、每一基金份额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。基金管理人应当在两日内编制收益分配报告书，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。

十四、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括：基金管理人的管理费、基金托管人的托管费、证券交易费用、基金合同生效后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、按照国家有关规定可以从基金资产中列支的其他费用。

1、基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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，基金托管费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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、其他基金费用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。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、发行公告等信息披露费用由基金管理人承担。

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。

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，无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

自基金合同生效以来，本基金的申购赎回实行的是固定费率，即申购费率 1.5%、赎回费率 0.5%。为了鼓励投资者积极申购及长期持有本基金，从 2004 年 11 月 12 日开始，本基金的申购和赎回费率标准将作部分调整，新的费率标准如下：

1、申购费

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在 1 天之内如果有多笔申购，适用按单笔分别计算，费率表如下：

申购金额	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)－1000万元	1.2%
1000万元(含)以上	0.8%

申购费用由基金申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费

赎回费用由赎回人承担，所收取的赎回费 40%归基金资产，60%用于支付注册登记费及其他必要的手续费。费率表如下：

持有基金份额期限	赎回费率
365天以内	0.5%
满365天不满730天	0.25%
满730天后	0%

3、经报中国证监会批准，基金管理人可以上述范围内调整申购费率和赎回费率，并最迟于新费率开始实施前两日在至少一种指定媒体予以公告。如果调高申购或赎回费率，则须经基金份额持有人大会通过。

在法规允许的情况下，基金管理人可以根据投资人的认购金额、申购金额的数量适用不同的认购、申购费率标准，但须按规定提前公告。

在法规允许的情况下，基金管理人可以对选择在赎回时缴纳认购费或者申购费的基金份额持有人，根据其持有基金份额的期限适用不同的认购、申购费率标准，但须按规定提前公告。

在法规允许的情况下，基金管理人可以根据基金份额持有人持有基金份额的期限适用不同的赎回费率标准，但须按规定提前公告。

（三）基金的税收

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。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 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、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，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。更换会计师事务所所在两日内公告。

十六、基金的信息披露

（一）信息披露的形式

本基金的信息披露将严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》、基金合同及其他有关规定进行。应予披露的基金信息将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(以下简称网站)等媒介披露。

（二）信息披露的内容及时间

1、基金募集信息

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

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

基金管理人将于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。

基金合同生效后，基金管理人将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。

2、基金运作信息

基金管理人将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。

基金管理人将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。

基金管理人将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。

基金管理人将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。

基金管理人将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。

3、基金临时信息

基金发生以下重大事件时，有关信息披露义务人应当在规定时间内编制临时报告书，予以公告。

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 提前终止基金合同；
- (3) 基金扩募；
- (4) 延长基金合同期限；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (8) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (9) 基金募集期延长；

(10) 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；

- (11) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (12) 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；
- (13) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (14) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (15) 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；
- (16) 重大关联交易事项；
- (17) 基金收益分配事项；
- (18) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (19) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (20) 基金改聘会计师事务所；
- (21) 变更基金份额发售机构；
- (22) 基金更换注册登记机构；
- (23) 开放式基金开始办理申购、赎回；
- (24) 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (25) 开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- (26) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (27) 开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (28) 中国证监会规定的其他事项。

在基金合同期限内，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。

（三）信息事务管理

基金管理人、基金托管人指定专人负责管理信息披露事务。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和网站上。

基金托管人须按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审

查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

招募说明书（包括定期更新的招募说明书）公布后，将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。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。

基金定期报告、基金资产净值公告公布后，将分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，供公众查阅、复制。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应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十七、风险揭示

（一）市场风险

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。市场风险主要包括：

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。

(二)管理风险

1、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；

2、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。

3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(三)流动性风险

1、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份额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。

2、基金投资组合的证券可能会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。

(四)特定风险

由于本基金为基础行业基金，根据基金合同规定 80%以上的股票资产要投资于特定的行业(基础行业)。可能会导致持仓组合中行业相对集中，如果基础行业出现较大波动，对基金的收益会有一定的影响。

(五)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、因业务竞争压力可能产生的风险；

4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

5、其他意外导致的风险。

十八、基金的终止与清算

（一）基金的终止

出现下列情形之一时，本基金终止。

1、在基金的存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 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本基金合同的规定终止该基金；

2、基金经持有人大会表决提前终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

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

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

6、法律、法规和中国证监会规定的其他终止事由。

（二）基金清算

1、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。

2、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。

3、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。

4、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) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后两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两日内公告。

6、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。

十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利与义务

1、基金份额持有人的权利与义务

(1) 基金份额持有人的权利

A. 按照基金合同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

份额持有人大会，并行使表决权；

B. 分享基金财产收益；

C. 监督基金运作情况，按基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务及财务状况资料；

D. 按基金合同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；

E. 取得基金清算后的剩余资产；

F. 知悉基金合同规定的有关信息披露内容；

G. 提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定应尽的义务；

H. 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利益受到损害时，有依法提起诉讼的权利；

I. 法律法规及基金合同规定的其他权利。

（2）基金份额持有人的义务

A. 遵守基金合同及相关业务规则；

B. 缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；

C. 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；

D. 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

E. 法律法规及基金合同规定的其他义务。

2、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

A. 自本基金成立之日起，根据法律、法规和基金合同的规定独立管理和运作基金资产；

B. 依据有关法律法规和基金合同的规定，获得基金管理费和其他约定和法定的收入；

C. 依照《基金法》等有关法律法规及基金合同的规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；

D. 依据有关法律法规及基金合同规定决定基金收益的分配方案；

E. 提议召开基金份额持有人大会；

F. 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合同、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投资者的利益；

G. 监督基金托管人。如认为基金托管人违反了基金合同或国家法律、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份额持有人的利益。除非法律法规、基金合同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；

H. 在基金存续期内，依据有关的法律法规和基金合同的规定，拒绝或暂停受理赎回申请；

I. 在法律法规和基金合同的框架内，制订和调整开放式基金业务规则；

J. 提名新的基金托管人；

K. 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；

L. 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；

M. 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；

N. 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；

O. 法律、法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

A. 遵守基金合同；

B. 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；

C. 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；

D. 设置相应的部门，并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

E. 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；

F. 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；

G. 除法律法规和基金合同另有规定外，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；

H. 接受基金托管人的监督；

I. 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；

J. 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；

K. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关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；

L. 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 200 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；

M. 依据基金合同决定基金收益分配方案，并按规定向基金份额持有人分配基金收益；

N. 按照有关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；

O. 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

P. 依据《基金法》等有关法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

Q. 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

R. 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；

S. 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；

T. 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；

U. 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

向基金份额持有人进行赔偿，该过错责任不因其退任而免除；

V. 因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

W. 监督基金托管人按基金合同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；

X. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

Y. 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

（1）基金托管人的权利

A. 根据法律、法规和基金合同的规定保管基金资产，监督本基金的投资运作；

B. 依据基金合同及托管协议约定获得基金托管费用；

C. 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了基金合同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、基金合同及托管协议规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

D. 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；

E. 监督基金注册登记人的基金注册及过户登记服务；

F. 法律、法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

A. 遵守基金合同；

B. 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；

C. 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；

D. 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；

E. 除依据《基金法》等有关法律法规及基金合同、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；

F. 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；

G. 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；

H. 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同、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；

I. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；

J. 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、托管协议等有关法律文件的规定；

K. 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、赎回价格的方法符合法律、法规、基金合同或其他法律文件的规定；

L. 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、基金合同或其他法律文件的规定；

M. 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；

N. 负责基金认购、申购和赎回业务的资金保管和清算；

O. 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合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

P. 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

Q. 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

R. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

S. 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；

T. 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；

U. 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；

V. 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；

W. 监督基金管理人按基金合同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，除法律法规和基金合同规定外，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；

X. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

Y. 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

1、召开事由

需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）基金扩募或者延长基金合同期限；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）更换基金管理人、基金托管人；
- （6）基金合同约定的其他事项。

2、召集方式

（1）正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额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）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；

（3）代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项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，代表基金份额百分之十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。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人有权自行召集，并报中国证监会备案。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

(4) 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。

3、通知

召开基金份额持有人大会，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。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的事项；
- (3) 会议的议事程序以及表决方式；
- (4) 有权出席基金份额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份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

4、会议的召开方式

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份额持有人大会。

(1) 现场开会。由基金份额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份额持有人大会。

出席会议的基金份额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% 以上的基金份额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份额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% 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份额持有人的书面表决意见。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、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份额持有人大会讨论的其他事项。

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

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份额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 名基金份额持有人作为该次基金份额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，由召集人至少提前 30 天公布拟讨论事项，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) 基金份额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、基金合同和会议通知的规定，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份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(4) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

①一般决议。一般决议须经出席会议的基金份额持有人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份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同，必须以特别决议通过方为有效。

(5) 基金份额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。

7、计票

(1) 现场开会

①如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，大会的主持人应

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

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

③如果会议主持人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份额持有人或者基金份额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

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起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。

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。

9、不可抗力

由于地震、洪水等自然灾害或不可抗力，导致基金份额持有人大会不能按时或按规定方式召开或会议中断，大会召集人应依照法律法规和本基金合同的规定采取必要措施及时通知或尽快召开。

（三）基金合同解除和终止的事由、程序

有下列情形之一的，基金合同终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。

清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。

清算组作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，报国务院证券监督管理机构备案并公告。

清算后的剩余基金财产，应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

（四）争议解决方式

本基金合同当事人发生纠纷时，可以通过协商或调解解决。本基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式。

本基金合同可印制成册，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基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以本基金合同正本为准。

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：巨田基金管理有限公司

住所：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：证监基金字[2003]33 号

企业类型：有限责任公司

1.1 营业期限：五十年

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国光大银行

住所：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

注册资本：82.17 亿元人民币

组织形式：股份制商业银行

营业期限：持续经营

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据相关法律法规和基金合同的规定，托管人应对基金管理人就基金资产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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）基金托管人定期对基金管理人在基金投资、运作等方面的运作是否严格按照相关法律法规和基金合同的规定进行监督和核查，对因基金管理人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金托管人应立即以书面的方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。基金托管人有权要求基金管理人赔偿基金因此所遭受的损失。

（2）基金托管人发现基金管理人违反相关法律法规和基金合同规定的行为，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。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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（3）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、基金合同或本托管协议，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，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，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资产的损失向基金管理人索赔。

2、根据相关法律法规和基金合同规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否将基金资产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金资产、是否按时将赎回资金和分配给基金份额持有人的收益划入基金管理

人清算账户等事项，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资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、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相关法律法规和基金合同规定，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。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、基金合同或本托管协议，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，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，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资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) 基金财产的保管

1、基金资产保管的原则

基金托管人应安全保管基金的全部资产。基金资产应独立于基金托管人和基金管理人的资产。

(1) 本基金所有资产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守相关法律法规和基金合同规定，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，安全、完整、谨慎、有效地持有并保管基金资产。

(2) 基金托管人应当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；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资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资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) 除依据相关法律法规和基金合同规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产；

(5) 基金托管人不得将基金资产转为其自有资产，不得将自有资产与基金资产进行交易，或将不同基金资产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任。

(6) 基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，将本基金资产与其托管的其他基金资产严格分开。

(7) 除依据相关法律法规和基金合同规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产；

(8) 未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2、基金成立时募集资金的验证

基金设立募集期满或基金发起人（即本基金的基金管理人）宣布停止募集时，基金发起人（即本基金的基金管理人）应将设立募集的全部资金存入其指定的验资专户；由基金发起人（即本基金的基金管理人）聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资报告出具后，基金成立。

如果基金不能成立，按相关法律法规和基金合同规定处理。

3、基金的银行账户的开设和管理

(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在其营业机构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、支付赎回款项、转换出金额、支付基金收益、收取认购款、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国人民银行和中国银行业监督管理委员会的有关规定。

(5) 涉及基金帐户变更或相关事项，由管理人和托管人按有关规定协商后处理。

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的名义在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司各开立证券帐户。

(2) 基金托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司各开立一个结算备付金账户，并通过该账户完成所托管证券投资基金的资金结算。

(3) 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。

(4) 基金托管人应当按规定以其自身的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立清算备付金账户，并通过该账户完成本基金的证券资金清算；

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许本基金从事其他投资品种的投资业务，则基金托管人应当以本基金的名义开设从事该投资业务的账户，并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(6) 基金资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。

（7）与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本首先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将该正本送达基金托管人处。

5、国债托管专户的开设和管理

（1）基金成立后，基金管理人负责代表基金向中国证监会和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场，并代表基金进行交易。由基金托管人以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设国债托管帐户，用于银行间国债现券和回购的交易和资金清算。

（2）基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、如监管机构关于基金证券账户和资金清算账户的开设和管理另有规定，则按监管机构的最新规定执行。

7、由基金分别按规定的标准向中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司缴纳结算保证金。首次托管的基金缴纳结算保证金后，若托管人新增其他托管基金，则托管人应相应按比例分摊调整各基金应承担的结算保证金。如监管机构关于基金缴纳结算保证金或其他资金、费用在另有规定，则按监管机构的最新规定执行。

（四）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指该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该基金资产净值除以计算日该基金总份额的价值。

2、基金管理人应于每工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同的规定。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马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人。

3、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，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权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，包括基金设立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，均由基金管理人和托管人负责分别保管。

（六）争议解决方式

基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，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该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京。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，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）基金或基金合同终止；

（2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；

（3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；

（4）发生相关法律法规和基金合同规定的终止事项。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额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、基金份额持有人投资交易确认服务

注册登记人保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额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、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额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、基金份额持有人开户确认单、交易对账单寄送服务

基金管理人在开户确认后向投资者寄送开户确认单。

基金管理人根据投资者需要向投资者提供交易对账单。原则上对账单每半年至少发送一次，以书面形式发送。

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，定期定额申购基金份额，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

6、客户投诉处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工坐席、呼叫中心自动语音留言、网上投诉栏目、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。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十二、其他应披露事项

1、2004 年 3 月 27 日基金管理人公告了《巨田基础行业证券投资基金成立公告》；

2、2004 年 3 月 27 日基金管理人公告了《巨田基础行业证券投资基金开放日常申购公告》；

3、2004 年 5 月 11 日基金管理人公告了《巨田基础行业证券投资基金开放日常赎回公告》；

4、2004 年 6 月 23 日基金管理人公告了《关于新股市值配售异常情况的公告》；

5、2004 年 7 月 21 日基金管理人公告了《巨田基础行业证券投资基金 2004 年第二季度报告》；

6、2004 年 8 月 28 日基金管理人公告了《巨田基础行业证券投资基金 2004 年半年度报告》；

7、2004 年 9 月 15 日基金管理人公告了《巨田基础行业基金关于新增银河证券为代销机构的公告》。

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复印件。

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

二十四、备查文件

- （一）中国证监会核准巨田基础行业证券投资基金募集的文件；
- （二）巨田基础行业证券投资基金基金合同；
- （三）巨田基础行业证券投资基金托管协议；
- （四）法律意见书；
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （七）中国证监会要求的其他文件。

上述文件存放在基金管理人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。

巨田基金管理有限公司

2004年11月9日