

# 巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）

## 招募说明书

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

二〇〇五年八月

### 重要提示

本基金经2005年5月9日中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】79号文核准募集。

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。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人认购（或申购）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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

## 目 录

一、绪 言	2
二、释 义	3
三、基金管理人	8
四、基金托管人	16
五、相关服务机构	19
六、基金的募集	26
七、基金合同的生效	31
八、基金份额的上市交易	32
九、基金份额的申购和赎回	34
十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记	42
十一、基金的投资	43
十二、基金的财产	49
十三、基金资产的估值	51
十四、基金的收益分配	54
十五、基金的费用与税收	56
十六、基金的会计与审计	60
十七、基金的信息披露	61
十八、风险揭示	65
十九、基金合同的终止与基金财产清算	67
二十、基金合同的内容摘要	69
二十一、基金托管协议的内容摘要	81
二十二、对基金份额持有人的服务	91
二十三、招募说明书的存放及查阅方式	93
二十四、备查文件	94

## 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》”)及相关法律法规和《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、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，下列词语具有以下含义：

- 基金或本基金：指巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）
- 基金合同或本基金合同：指《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及基金合同当事人对其不时做出的修订
- 招募说明书：指《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》以及基金管理人在基金合同生效后每6个月结束之日起45日内进行的对招募说明书的更新
- 基金份额发售公告：指《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
- 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及协议当事人对其不时做出的补充及修订
- 《证券法》：指1998年12月29日经第9届全国人民代表大会常务委员会第6次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》
- 《基金法》：指2003年10月28日第10届全国人民代表大会常务委员会第5次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》
- 《运作办法》：指2004年6月29日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》
- 《销售办法》：指2004年6月29日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》
- 《信息披露办法》：指2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》

《业务规则》：	指2004年8月17日深圳证券交易所发布并于2004年8月17日起施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构：	指中国银行业监督管理委员会、中国人民银行或其他经国务院授权的机构
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管理人、基金托管人和基金份额持有人
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
基金销售代理人：	指符合中国证监会有关规定的条件并与基金管理人签订了销售服务代理协议，代为办理基金销售服务业务的机构，简称代销人
销售机构：	指基金管理人和基金销售代理人
注册登记业务：	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金帐户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易确认、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是中国证券登记结算有限责任公司
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者
机构投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

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人
元：	指人民币元
基金合同生效日：	指本基金募集符合基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认之日
基金合同终止日：	指基金合同规定的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合同的日期
开放日：	指销售机构为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日
基金募集期：	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不超过3个月
基金存续期：	指基金合同生效至基金合同终止，基金存续的不定期之期限
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
T 日：	指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
T+n 日：	指自T 日起第n 个工作日（不包含T 日）
日/天：	指公历日
月：	指公历月
认购：	指在基金募集期内，投资人购买本基金份额的行为
申购：	指在基金合同生效后投资人申请购买本基金份额的行为
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
巨额赎回：	指基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日基金总份额10%时的情形
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金（包括本基金）的基金份额转为基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金

	（包括本基金）的基金份额的行为
销售场所：	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统：	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
发售：	指场外认购和场内认购
场外认购：	指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为
场内认购：	指基金募集期内投资人通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为
日常交易：	指申购、赎回和上市交易
场内申购、赎回	指场内会员单位接受投资人委托向深圳证券交易所交易系统申报的基金份额的申购、赎回
上市交易：	指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
系统内转托管：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入

基金资产总值：	指基金所购买各类证券及票据价值、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
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：	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
基金帐户：	指基金注册登记人为投资人开立的记录其持有的基金份额及其变更情况的帐户
基金交易帐户：	指销售机构为投资人开立的记录其通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的帐户
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站或其他媒体
不可抗力：	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或无人破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作、战争、动乱或瘟疫等



### 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：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

办公地址：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 3 日

全国统一客服电话：400-8888-668

电话：（0755）82993636

传真：（0755）82990384

联系人：李锦

注册资本：1 亿元人民币

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]33 号

股东及股权结构：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）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

王一楠先生，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，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，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，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，解放军第二外国语学院毕业。1996 年至今任职浙江中大集团控股有限公司，现任浙江中大集团控股有限公司董事长，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，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，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，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，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，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，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，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，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，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。2003 年至今任巨田基金管理有限公司监察稽核部总监。曾就职于中国国际金融有限公司、巨田证券有限责任公司。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，中国社会科学院研究生院法学系研究生课程毕业。10 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。

李锦女士，吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士。8 年证券从业经验。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理；曾任巨田基金管理有限公司基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

### 4、本基金拟任基金经理简介

冀洪涛先生，东北财经大学经济学硕士，6 年证券从业经验。历任华夏证券有限责任公司大连业务部研发部投资顾问、投资部债券投资经理；大连证券有限责任公司研发总部副经理、兼沈阳业务部副总经理；巨田证券有限责任公司资产管理部投资经理、投资部投资经理；2004 年 3 月起任巨田基金管理有限公司巨田基础行业基金基金经理助理。

### 5、投资决策委员会成员

主任委员：许明先生，简历同上。

委员：

赵昱东先生，经济学硕士，投资总监，7年证券从业经验。曾服务于巨田证券有限责任公司，历任研究所副所长、行业与上市公司研究部经理、资产管理部副经理、投资银行部项目经理，北京全华国际招商中心项目经理，北京煤炭交易所。

陈守红先生，投资管理部副总监、巨田基础行业证券投资基金经理，34岁，金融学博士，深圳金融学会理事，8年证券从业经验。曾服务于光大证券、平安证券、兴业基金，历任光大证券高级经理、平安证券综合研究所副所长、兴业基金研究总监。2003年被《新财富》评为“水、电、煤”行业全国最佳分析师。

陈忠强先生，投资管理部副总监、巨田基础行业证券投资基金经理，37岁，11年证券从业经验，特许金融分析师（CFA）。先后服务于友邦保险公司、怡富资产管理公司、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，历任研究主任、投资分析师、基金经理助理、基金经理等职。

冀洪涛先生，简历同上。

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、分别记帐，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、编制基金半年度、年度等定期报告；

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、帐册、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。公司的内部控制机制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、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、公司固有财产、其他财产的运作必须分离。

（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，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）内部控制体系的主体包括董事会、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，实行双人负责的制度。属于单人单岗处理的业务，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检查和及时反馈，并向风险控制委员会和总经理定期与不定期报告，同时向督察长通报。

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制度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。

### 4、内部控制的五个要素

内部控制包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控五个基本要素。

（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

公司建立清晰的报告制度，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，或者预见到将要发生违规事件，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，同时向督察长报告。

### （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，保证内部控制制度的落实。风险控制委员会与投资决策委员会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制度的声明

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制度的披露真实、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）基金托管人概况

#### 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

批准设立机关：中华人民共和国国务院

批准设立文号：国函[1992]7号

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，中国投资公司（新加坡）总经理，中国人民银行外资金融机构管理司副司长，中国光大银行副行长，中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理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、中国光大银行副董事长、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（主持工作）。

本基金托管业务主管石立平女士，曾供职于中国农业银行国际业务部、中国光大银行会计结算部，现为中国光大银行基金托管部业务管理处负责人。

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12月31日，中国光大银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、3只委托资产；托管资金总规模67.58亿元，其中：证券投资基金64.28亿元，委托资产3.3亿元。

## （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；保护基金份额持有人、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操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（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独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，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《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》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10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管理人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、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、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，立即以口头或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、巨田基金管理有限公司直销中心

##### （1）深圳

办公地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 楼

电话：（0755）82990365

传真：（0755）82990631

联系人：许菲菲

全国统一客服电话：400—8888—668

##### （2）北京

办公地址：北京市东三环北路 15 号恒安大厦 13 层

电话：（010）65085599 转 8002

传真：（010）65952371

联系人：刘红

##### （3）上海

办公地址：上海市曹杨路 540 号中联大厦裙楼 3 楼

电话：（021）62440522

传真：（021）62442515

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）68098317

传真：（010）68560314

联系人：刘静

网址：www.cebbank.com

**（2）交通银行股份有限公司**

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：蒋超良

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：王玮

网址：www.bankcomm.com

**（3）广发证券股份有限公司**

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：（020）87555888

传真：（020）87557985

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

**（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

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 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：（021）68419974

联系人：杨盛芳

网址：www.xyzq.com.cn

**（6）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：400-8888-666

传真：（021）62569400

联系人：芮敏祺

联系电话：（021）62580818-213

网址：www.gtja.com

**（7）北京证券有限责任公司**

注册地址：北京市海淀区车公庄西路乙 19 号华通大厦B座 10-16 层

法定代表人：凌新源

电话：（010）68431166-8009

传真：（010）88018657

联系人：白源

网址：www.bjzq.com.cn

**（8）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

联系电话：（027）65799560

服务热线：（027）65799883

传真：（027）85481532

联系人：毕艇

网址：www.cz318.com.cn

**（9）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) 66568613、(010) 66568587

联系人：赵荣春、郭京华

网址：www.chinastock.com.cn

**(10) 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

法定代表人：黎晓宏

电话：400-8888-108（免长途费）；(010) 65178899-86080

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

**(11) 山西证券有限责任公司**

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：吴晋安

联系电话：(0351) 8686703

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

**(12) 世纪证券有限责任公司**

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层

法人代表：段强

联系人：夏尚

电话：(0755) 83199511

传真：(0755) 83199545

网址：www.csc.com.cn

**(13) 齐鲁证券有限公司**

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：（0531）2024184

传真：（0531）2024197

联系人：傅咏梅

网址：www.qlzq.com.cn

**（14）东莞证券有限责任公司**

注册地址：广东省东莞市可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：周建辉

热线电话：961130 （0769）2413222

联系人：张劲春

电话：（0769）2119353

传真：（0769）2119423

网址：www.dgzq.com.cn

**（15）民生证券有限责任公司**

注册地址：北京市朝阳区朝外大街16号中国人寿大厦1901室

法定代表人：岳献春

联系人：杨魁华

联系电话：（010）85252605

公司网址：www.msyzq.com

**（16）西北证券有限责任公司**

注册地址：宁夏银川民族北街1号

法定代表人：姜巍

联系人：杨晓东

联系电话：（0951）6024716

公司网址：www.nws.com.cn

**（17）华西证券有限责任公司**

注册地址：四川省成都市陕西街239号

法定代表人：张慎修

联系人：杨玲



联系电话：（0755）83025688

客服电话：400—8888—818

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

**（18）湘财证券有限责任公司**

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东银城东路 139 号华能大厦

法定代表人：陈学荣

联系人：陈伟

电话：（021）68634518-8613

开放式基金客服电话：（021）68865020

传真：021-68865938

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

**（19）国海证券有限责任公司**

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：（0755）82485852

传真：（0755）82485852

联系人：张建勋

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

**（20）信泰证券有限责任公司**

注册地址：江苏省南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

联系电话：（025）84784782

传真：（025）84784741

联系人：舒萌菲

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

**（21）天相投资顾问有限公司**

注册地址：中国北京市朝阳区幸福村中路锦绣园 D 座

法定代表人：林义相

联系电话：（010）84533151 转 802、822

联系人：陈少震

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

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：（010）58598839

传真：（010）58598834

联系人：朱立元

## （三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路号建外 SOHU A 座 31 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路号建外 SOHU A 座 31 层

负责人：王玲

电话：（010）58785588、（0755）82125533

联系人：冯艾

经办律师：宋萍萍、彭晋

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：深圳天健信德会计师事务所有限责任公司

注册地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 1501、16 层

办公地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 1501、16 层

法人代表：朱祺珩

联系人：龙湖川

联系电话：（0755）82903666

经办注册会计师：干长如、龙湖川

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

基金募集申请于2005年5月9日经中国证监会证监基金字【2005】79号文核准。

### （一）基金的类型和存续期间

本基金为混合型证券投资基金，基金运作方式为契约型上市开放式，基金的存续期为不定期。

### （二）募集方式

本基金将通过基金管理人的直销网点及销售代理机构的代销网点（具体名单见基金份额发售公告）公开发售，同时通过深圳证券交易所上网定价发售。

### （三）基金份额的场外认购

投资人可通过场外认购和场内认购两种方式认购本基金。本节只针对基金份额的场外认购，认购后登记在注册登记系统的基金份额适用本节的相关规定。

#### 1、场外基金份额的发售时间、方式和对象

（1）募集期限：本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。具体时间详见基金份额发售公告。

（2）销售渠道：本公司的直销网点和销售代理人的代销网点（具体名单见基金份额发售公告）。

（3）销售对象：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外）和合格境外机构投资者。

#### 2、场外基金份额的认购和持有限制

（1）基金份额的场外认购采用金额认购方式。

（2）投资人认购基金份额采用全额缴款的认购方式。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，已经正式受理的认购申请不得

撤销。

（4）在募集期内，代销网点个人投资者首次单笔最低认购金额为人民币 1000 元（含认购费），追加最低认购金额每笔不低于 1000 元（含认购费）；直销网点投资人首次单笔最低认购金额为人民币 1000 元，追加最低认购金额为人民币 1000 元（含认购费）。募集期间可重复认购，且按每次认购所在费率档次分别计费。

（5）认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

### 3、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额面值：本基金份额面值为 1.00 元人民币。

（2）认购费率

本基金场外认购费率如下表：

认购金额区间	认购费率
小于 50 万元	1.0%
大于等于 50 万元小于 500 万元	0.8%
大于等于 500 万元小于 1000 万元	0.5%
大于等于 1000 万元	收取固定费用 1000 元

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，不列入基金财产。

（3）场外认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购方式认购，计算公式如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 净认购金额 × 认购费率

认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) / 基金份额面值

认购份额计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后 2 位。

例：某投资人认购本基金 10000 元，认购费率为 1%，假定认购期产生的利息为 10 元，则可认购基金份额为：

净认购金额 = 10000 / (1 + 1%) = 9900.99 元

认购费用 =  $9900.99 \times 1\% = 99.01$  元

认购份额 =  $(9900.99 + 10) / 1.00 = 9910.99$  份

即：该投资人投资 10000 元本金可得到 9910.99 份基金份额。

#### 4、场外认购的程序

(1) 申请方式：书面申请或基金管理人公布的其他方式。

(2) 认购款项支付：基金投资人认购时，采用全额缴款方式。

#### 5、认购的确认

投资人 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。投资人可根据销售机构的有关规定查询认购接受结果，并可于基金合同生效后在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心取得认购份额确认书或查询认购份额确认信息。

#### 6、认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记人的记录为准。

### **（四）基金份额的场内认购**

本节仅针对基金份额的场内认购，发售后登记在证券登记结算系统的基金份额适用本节的相关规定。

#### 1、场内基金份额的发售时间、方式和对象

(1) 募集期限：自基金份额发售之日起不超过3个月。在发售期内，深圳证券交易所将于交易日交易时间内持续挂牌定价销售本基金份额（具体时间见基金份额发售公告）。

(2) 销售渠道：本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，销售渠道为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）。

(3) 销售对象：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外）和合格境外机构投资者。

#### 2、场内基金份额的认购和持有限制

(1) 基金份额的场内认购采用份额认购方式。

(2) 投资人认购基金份额采用全额缴款的认购方式。

(3) 投资人在募集期内可以多次认购基金份额，已经正式受理的认购申请不得撤销。

(4) 场内认购首次单笔最低认购份额为1000份，超过1000份的须为1000份的整数倍。场内认购每笔认购量最大不能超过99999000份。

(5) 认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

### 3、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 本基金份额的面值为人民币1.00元，挂牌价格为基金面值。投资人认购采用全额缴款的认购方式。

(2) 投资人场内认购需缴纳认购费用。认购费用由认购人承担，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，不列入基金财产。

(3) 深圳证券交易所会员单位可按照基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定投资人场内认购的券商佣金比率。

(4) 场内认购金额和利息折算的份额的计算

认购金额 = 挂牌价格 × (1 + 券商佣金比率) × 认购份额

券商佣金 = 挂牌价格 × 认购份额 × 券商佣金比率

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

利息折算的份额 = 利息 / 挂牌价格

例：某投资人认购本基金10000份，若该投资人所在的深圳证券交易所会员单位设定券商佣金比率为1%，假定该笔认购产生利息10元。则认购金额和利息折算的份额为：

挂牌价格 = 1.00元

认购金额 = 1.00 × 10000 × (1 + 1%) = 10100元

利息折算的份额 = 10 / 1.00 = 10份

即：投资人认购10000份基金份额，需缴纳10100元，利息折算的份额为10份。

### 4、认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的份额保留至1份，余额计入基金财产。

### 5、认购程序

认购时间安排、投资人认购时应提交的文件和办理的手续、认购的方式及确认等均在本基金份额发售公告中详细列明，详情请参看基金份额发售公告。

本基金募集期结束前具有基金代销业务资格的证券公司即可代理基金份额的场内发售。尚未取得基金代销业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的买卖。

## 七、基金合同的生效

（一）基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的情况下，由基金管理人委托具有证券从业资格的会计师事务所对认购资金进行验资并出具验资报告，基金管理人应将验资报告及本基金备案材料提交中国证监会，中国证监会将于收到前述材料后予以书面确认，自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。管理人将于收到中国证监会书面确认文件的次日发布基金募集情况及基金合同生效公告。

（二）募集期间募集的资金应存入专门帐户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（三）募集期限届满，基金募集未能达到本条上述基金合同备案条件，则基金募集失败。在此情况下：基金管理人应承担全部募集费用，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后 30 日内退还基金认购人；基金管理人、基金托管人及销售人不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售人为基金支付之一切费用应由各方各自承担。



## 八、基金份额的上市交易

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

### （一）拟上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （二）拟上市交易的时间

本基金拟在基金合同生效后 3 个月内向深圳证券交易所申请上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### （六）上市交易的注册登记

投资人 T 日买入成功后，注册登记人在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人 T 日卖出成功后，注册登记人在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

#### （七）上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

#### （八）暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人；
- 2、基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份；
- 3、违反国家有关法律、法规，被中国证监会决定暂停上市；
- 4、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

#### （九）恢复上市的公告

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登恢复上市公告。

#### （十）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，基金管理人在报经中国证监会批准后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

## 九、基金份额的申购和赎回

### （一）场内基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回办理的场所

有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见开放申购赎回公告）。

#### 2、申购、赎回帐户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票帐户或证券投资基金帐户

#### 3、申购与赎回办理的开放日及开放时间

##### （1）开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

##### （2）申购与赎回的开始时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效日后不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购、赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日 3 个工作日前在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

#### 4、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。申购申报单位为 1 元人民币，赎回申报单位为 1 份基金份额。

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

#### 5、申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

（1）申购份额的计算方法：

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

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

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

场内申购份额保留到整数位，不足1份对应的资金返还至投资者资金帐户。

例：某投资者通过场内投资10000元申购本基金，假设申购费率为1.5%，申购当日基金份额净值为1.0250元，则其申购费用、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0250 = 9611.92 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为9611份，不足1份部分对应的申购资金返还给投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 9611 \times 1.025 = 9851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

（2）赎回金额的计算方法

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金总额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资者赎回本基金10000份基金份额，持有时间为10个月，赎回费率为0.35%，假设赎回当日基金份额净值为1.0250元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0250 = 10250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10250 \times 0.0035 = 35.88 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10250 - 35.88 = 10214.12 \text{ 元}$$

即：投资者赎回10000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为1.0250元，则可得到10214.12元净赎回金额。

6、申购与赎回的登记结算

基金申购、赎回的登记结算按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

## （二）场外基金份额的申购与赎回

### 1、申购与赎回场所

（1）本公司直销网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（2）经本公司委托，具有代销本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（3）本基金管理人同时考虑在适当的时候，投资人可通过基金管理人或指定基金代销机构进行电话、传真或网上等形式的申购、赎回，具体规则由基金管理人另行确定并公告。

### 2、申购与赎回的开放日及开放时间

（1）开放日及开放时间

基金开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回时除外）。

申购、赎回业务的办理时间为每交易日的15:00以前，15:00以后提交的申请，按下一交易日申请处理。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

（2）基金合同生效后申购开始日

本基金合同生效后最迟不超过3个月开始办理申购。

（3）基金合同生效后赎回开始日

本基金合同生效后最迟不超过3个月开始办理赎回。

投资人在规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。

在确定了基金申购、赎回开放日的时间后，由基金管理人最迟在开放日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### 3、申购和赎回数额限制

（1）申购数额的限制

投资人通过代销网点首次单笔最低申购金额为1000元，追加最低申购金额为

1000元；直销网点投资人首次单笔最低申购金额为人民币1000元，追加最低申购金额为人民币1000元（含申购费）。当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制；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，但法律法规、中国证监会、本基金招募说明书另有规定的除外。

#### （2）赎回数额的限制

赎回的最低份额为500份基金份额，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发生交易帐户的基金份额余额少于500份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

（3）基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述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个工作日至少在一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。

### 4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购、赎回申请可以在当日15：00以前撤销；

（4）基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### 5、申购、赎回的程序

#### （1）申购与赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金。投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额。否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### （2）申购、赎回申请的确认与通知

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人可向销售机构或以销售

机构规定的其它方式查询申购、赎回的成交情况。

### （3）申购与赎回的款项支付的方式与时间

基金申购采用全额缴款方式。投资人赎回申请成功后，基金管理人应会同基金托管人按有关规定在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

## 6、申购份额与赎回金额的计算方式

### （1）基金申购份额的计算

申购份额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

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

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

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

例：某投资人投资10000元申购本基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0500 = 9383.07 \text{份}$$

即：投资人投资10000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则可得到9383.07份基金份额。

### （2）基金赎回金额的计算

赎回金额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人赎回10000份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0500 = 10500 \text{元}$$

赎回费用 = 10500 × 0.5% = 52.5元

净赎回金额 = 10500 - 52.5 = 10447.5元

即：投资人赎回本基金10000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则其可得到的净赎回金额为10447.5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。

### （三）暂停或拒绝申购的情形和处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金资产净值；
- （3）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；
- （4）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或基金注册登记人的技术保障和人员支持等不充分；
- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形；
- （6）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

2、发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。

### （四）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

1、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形；



（5）基金合同约定的其他特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日向中国证监会报告备案。

已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付的部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

2、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。

#### （五）其它暂停申购、赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金份额申购、赎回申请的，应当报经中国证监会备案。经备案后，基金管理人应当及时在指定媒体上刊登暂停申购、赎回公告。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理。

#### （六）拒绝或暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生暂停申购和赎回情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告；

2、如果发生暂停的时间为一日，第2个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回公告并公布最近一个工作日的基金份额净值；

3、如果发生暂停的时间超过一日但少于2周，暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回公告，并在重新开放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、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周至少重复刊登提示性公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购、赎回公告并在重新开

放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

### （七）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若单个开放日基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时，即认为基金发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付基金投资人的赎回申请时，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可能导致本基金份额持有人的利益受损或无法实现时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日本基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个帐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工作日办理。转入第2个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的本基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。场内的赎回申请在遇到巨额赎回时不予办理延期赎回，当日未获受理部分予以撤销。

（3）巨额赎回的公告：当本基金发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内公告，并说明有关处理方法。

本基金连续2个工作日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受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20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上进行公告。

## 十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### （一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金帐户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券帐户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易，也可直接申请赎回。

### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

### （三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十一、基金的投资

本基金所指的资源是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，提升企业核心竞争力，具有战略发展意义的自然资源，具体包括土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源等。

资源类上市公司为拥有自然资源、开采自然资源或直接对自然资源进行加工、开发的上市公司。具体包括：拥有土地资源、水资源或者生物资源的农林牧渔业上市公司；拥有或开采矿产资源的采掘业上市公司；拥有基础原材料基地的制造业上市公司；对水资源进行开发的水电、自来水类上市公司；对土地资源、水资源进行开发的交通设施类上市公司；对土地资源进行开发的房地产上市公司；对旅游资源进行经营、开发的旅游业上市公司。

本基金管理人认为：在我国及世界范围内，自然资源具有绝对稀缺和相对稀缺的总体特征。有限的资源储量与持续增长的需求，以及资源定价的市场化决定了自然资源价值将长期持续提升。

本基金管理人研究表明，目前我国资源类上市公司的盈利能力高于市场平均水平，充分体现了资源类公司的价值性；同时，资源类上市公司的市盈率、市净率、企业总价值与息税、折旧及摊销前盈利之比(EV/EBITDA)均低于市场平均水平，其相对投资价值比较明显。

本基金立足于充分把握自然资源价值性、稀缺性和独占性的特点，通过投资于拥有优质土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源的上市公司，为投资者获取长期、稳定、丰厚的投资回报。

### （一）投资目标

将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

### （二）投资方向

在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，其中投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的 80%。

投资比例：在正常市场情况下，本基金资产中股票投资比例的变动范围为：基金资产净值的 30%-95%；债券投资比例的变动范围为：基金资产净值的 0%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

### （三）投资策略

本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合，并注重资产在资源类各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

#### 1、本基金的股票投资策略及选股流程

##### （1）本基金的股票投资策略：

A、根据资源的经济发展价值，注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析；对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。

B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性较强，所以本基金将依据市场判断和政策分析，同时根据类别行业的周期性特点，采取适当的时机选择策略，以优化组合表现。

##### （2）本基金的选股流程：

A、根据上市公司资源的类别、数量、与主营业务的密切程度判断公司是否属于资源类公司，所有资源类公司形成资源类股票库；

B、在资源类股票库的基础上剔除 ST 等财务异常公司股票形成投资的基准库；

C、运用资源评价体系对基准库公司所拥有的资源进行评级并作三级分类，由一级资源类公司形成备选库；

D、运用投资价值综合评价系统对备选库公司的财务状况、内在价值、相对价值

进行综合评级，依据系统评价的结果，并结合公司实地调研的结论建立起基金的投资组合；

E、对投资组合内股票的收益、风险特征、流动性指标、预期收益率进行量化分析，在分析结果基础上构造有效投资组合，以实现组合整体的风险收益最优化。

## 2、本基金的债券投资策略

本基金采取“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、市场资产配置、券种选择3个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

## （四）投资决策程序

### 1、投资决策依据

- （1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- （2）国内外宏观经济发展状况、资源类行业和企业经济运行状况；
- （3）国家财政政策、货币政策、产业政策；
- （4）证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资人状况；
- （5）上述因素的作用机制和最终对证券市场未来走势的影响。

### 2、投资决策机制

本基金的投资决策机制为投资决策委员会领导下的基金经理负责制以及研究驱动投资。

（1）投资决策委员会负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略，对基金经理授权，同时对整个投资活动进行全程监督。

（2）基金经理负责基金的投资管理。在投资决策委员会的授权范围内，根据投资决策委员会制定的投资原则及资产配置方案，拟订基金的投资组合，并负责实施。

（3）“研究驱动投资”是本基金的投资原则。投资决策委员会以研究部提供的策略报告为基础，对基金的投资原则、策略及资产配置比例进行决策。研究部对基金投资组合及重点投资品种提出投资建议，对重大突发事件提供评估意见和决策建议。

### 3、投资决策程序

(1) 研究发展部通过科学系统的研究工作，为投资决策委员会及投资部提供行业与上市公司研究报告及相关策略报告，作为投资决策委员会进行决策和投资部拟定投资方案的基本依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，投资决策委员会根据研究发展部和投资部提交的策略报告或投资建议方案制定基金的投资原则、投资目标和资产配置策略。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3) 基金经理根据授权承担本基金投资执行工作，在执行投资决策委员会制定的投资决策的原则下，负责具体的投资方案的实施。在基金经理权限内的，由基金经理自主实施；超过基金经理权限的，经投资决策委员会批准后实施。基金经理在研究员报告的基础上在权限内调整投资组合，下指令给集中交易室，由交易主管分配给交易员执行指令。

(4) 监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行监控。

(5) 如果证券市场、相关行业及上市公司情况发生变化，需对投资组合进行相应调整时，基金经理应提请召开临时投资决策委员会会议，经批准后方可实施。

(6) 基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

### （五）业绩比较基准

基金业绩比较基准：

70%× 中标 300 指数+30%× 中信全债指数

基准指数的构建考虑了 3 个原则：

1、公允性。选择市场认同度比较高的中标 300 指数、中信全债指数作为计算的基础指数。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，虽然股票最高投资比例可达到 95%，但这一投资比例所对应的是阶段性、非常态的资产配置比例。在一般市场状况下，为控制基金风险，本基金股票投资比例会控制在 70%左右，债券投资比例控制在 30%以内。根据基金在正常市场状况下的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。

3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来

使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、30%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

## （六）投资限制

### 1、组合限制

本基金以《基金法》、《运作办法》等相关法律、法规和基金合同为基础，通过构造投资组合降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

（2）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，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本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（4）本《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

（5）法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。

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第（1）和第（2）项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

### 2、建仓期

本基金建仓时间为基金合同生效之日起 3 个月。

### 3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、



基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、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活动。

如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

**（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法**

1、不谋求对上市公司的控股；

2、有利于基金财产的安全和增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

## 十二、基金的财产

### （一）基金财产的构成

#### 1、基金资产总值

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

其构成主要有：

- （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。

#### 2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （二）基金财产的帐户

本基金财产以基金托管人名义开立基金托管专户、以基金的名义在基金托管人营业机构开设基金银行存款帐户和证券交易资金帐户，以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券帐户，以基金的名义开立银行间债券托管帐户，并报中国证监会及银行业监管机构备案。开立的基金各类专用帐户，与基金管理人、基金托管人、销售代理人、注册登记人自有的财产帐户以及其他基金财产帐户相独立。

### （三）基金财产的保管与处分

1、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。

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，归入基金财产。

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财产。

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、基金资产的估值

### （一）估值日

基金资产估值日为相关的证券交易所的正常交易日，估值时点为上述证券交易所的收市时间。

### （二）估值方法

1、上市流通的股票按估值日的收盘价计算；该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

2、未上市股票分两种情况：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股票估值日的收盘价计算，该日无交易的，以最近一日的收盘价计算；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（如可转换债券）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和未上市债券按购入时不含利息的成本估值；

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、未上市的其他证券以其成本价计算；

9、派发的股息红利、债券利息以除权日为止的应获得额计算；

10、如遇特殊情况而无法或不宜以上述方法确定基金资产价值时，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；

11、如国家对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。

### （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，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以及其他权证等资产进行估值。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式并加盖业务公章发送基金托管人，基金托管人按法律法规和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加盖业务公章返回给基金管理人。

### （五）基金份额净值计价错误的确认与处理

本基金基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后4位，国家另有规定的从其规定。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，视为基金份额净值计价错误。

基金管理人和基金托管人采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金管理人确认已经发生基金份额净值计价错误情形时，基金管理人立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。计价错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人将公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

因发生差错造成基金份额持有人损失的，由基金管理人负责赔偿，赔偿原则如下：

- 1、赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失；
- 2、基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；
- 3、基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给每一单一当事人造成10元人民币以上的损失；
- 4、基金管理人在赔偿基金份额持有人后，有权向有关责任方追偿。

### （六）暂停估值的情形及处理

- 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无法准确评估基金资产价值时。
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金资产净值的确认

基金管理人将基金资产净值的估算结果加盖公章后通过加密传真发送给基金托管人，经基金托管人复核确认无误后加盖公章，再通过加密传真发送给基金管理人。

#### （八）特殊情形的处理

1、基金管理人按本基金估值方法的第 10 条，所造成的误差不作为基金份额净值计价错误处理；

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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，但未能发现错误的，由此造成的基金份额净值计价错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十四、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，最多 6 次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、场外投资人可以选择现金分红或红利再投资（即基金份额持有人将所获分配的现金收益按照本基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额）；场内投资人只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；

- 3、基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）基金收益分配方案的确定与公告

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。

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，报中国证监会备案后公告。

（五）基金收益分配中发生的费用

- 1、 红利分配采用红利再投资方式的，免收申购费用。
- 2、 收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。



## 十五、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关的基金费用种类：

- （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）基金合同生效后的会计师费和律师费；
- （7）在中国证监会有明确规定的情况下，基金管理人按照有关规定收取的基金持续销售和服务基金份额持有人的销售服务费；
- （8）按照国家有关规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计算，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。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 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，本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计算，

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，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。

（3）上述第一条中 3—8 项基金费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用。

### 3、管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定报刊刊登公告。

#### （二）与基金销售有关的费用

##### 1、认购费用

本基金的发售包括柜台（场外）认购和深圳证券交易所（场内）认购两种方式。投资人通过直销网点和代销网点认购本基金时，采用“金额认购”的方式，通过深圳证券交易所上网定价认购时，采用“份额认购”的方式。

认购费用在认购时收取并由认购人承担，不高于 1.0%，随认购金额的增加而递减。

具体收费标准如下表所示：

认购金额区间	认购费率
小于 50 万元	1.0%
大于等于 50 万元小于 500 万元	0.8%
大于等于 500 万元小于 1000 万元	0.5%
大于等于 1000 万元	收取固定费用 1000 元

投资人场内认购的券商佣金比率由深圳证券交易所会员单位按照基金招募说明

书中约定的场外认购的认购费率设定。

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，不列入基金财产。

## 2、 申购费用

本基金的申购包括柜台（场外）申购和深圳证券交易所（场内）申购两种方式。

本基金申购费用在申购时收取并由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金的申购费率为最高不超过 1.5%，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用按单笔分别计算。投资人场外申购的申购费率按申购金额分段设定如下：

申购金额区间	申购费率
小于 50 万元	1.5%
大于等于 50 万元小于 500 万元	1.2%
大于等于 500 万元小于 1000 万元	0.8%
大于等于 1000 万元	收取固定费用 1000 元

投资人场内申购的申购费率由深圳证券交易所会员单位按照基金招募说明书中约定的场外申购的申购费率设定。

## 3、 赎回费用

赎回费率为最高不超过 0.5%，投资人在场外赎回的赎回费率按持有时间分段设定如下：

持有基金份额期限	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年(含)至 2 年	0.25%
持有期 2 年(含)以上	0%

投资人场内赎回的赎回费率为 0.35%。

本基金的赎回费在投资人赎回基金份额时收取，所收取的赎回费 25%归基金资

产，其余的用于支付注册登记费及其他必要的手续费。

#### 4、申购赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准，调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### 5、其他费用

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，从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、基金份额发售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得列入基金费用。

其他不得列入基金费用的项目依据有关规定执行。

##### （四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

## 十六、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每年1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 4、会计核算制度依据国家相关规定执行；
- 5、本基金独立建帐、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人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、基金管理人应聘请与基金管理人、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；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所应在2日内公告。

## 十七、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《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《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》、《业务规则》、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至少一种全国性报刊和基金管理人的互联网网站(<http://www.jtfund.com>)、基金托管人的互联网网站(<http://www.cebbank.com>)等媒介披露。

### （二）信息披露的内容及时间

#### 1、基金募集信息

（1）基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人将在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（2）基金管理人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。

（3）基金管理人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，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

#### 2、基金运作信息

（1）基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

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

（3）基金管理人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。

(4)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。

基金管理人在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(5)基金管理人在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(6)基金管理人在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(7)基金管理人在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

(8)基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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

### 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在 2 日内编制临时报告书，予以公告。

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 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 50%；
- （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 30%；
- （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 0.5%；
- （18）基金改聘会计师事务所；
- （19）变更基金份额发售机构；
- （20）基金更换注册登记机构；
- （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）中国证监会规定的其他事项。

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

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将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、基金上市交易的证



券交易所。

### （三）基金信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律、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。

3、基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

4、招募说明书（包括定期更新的招募说明书）公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人应保证文本内容与所公告的内容完全一致。

## 十八、风险揭示

### （一）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而产生风险，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。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### （二）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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资

人的申购和赎回。由于开放式基金在国内发展历史不长，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金财产变现困难，基金面临流动性风险。

#### （四）投资策略风险

本基金重点投资于资源类上市公司，虽然资源的长期价值将不断提升，但在经济发展的各阶段，部分资源类行业的周期性变化可能会带来资源产品价格的波动，进而影响到资源类上市公司的经济效益，给投资带来一定的不确定性，从而形成策略风险。本基金以对资源类行业作为重点配置对象，也面临行业投资过于集中而带来的投资风险。

#### （五）上市交易的风险

本基金将在发售结束后在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

#### （六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 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；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、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；
- 7、其他意外导致的风险。

## 十九、基金合同的终止与基金财产清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 3、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 4、法律、法规及基金合同约定的其他情形。

### （二）基金财产的清算

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

#### 1、基金财产清算小组

基金合同终止之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组。

（1）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；
- （2）清算小组对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行评估；
- （4）对基金财产进行变现；
- （5）将基金清算结果报告中国证监会；
- （6）公布基金清算公告；
- （7）进行基金剩余财产的分配。

#### 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财产中支付。

#### 4、基金清算剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5、基金财产清算的公告

清算小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，报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

##### （1）基金管理人的权利

- 1) 依法并依照基金合同的规定独立运用并管理基金资产；
- 2) 依照基金合同的相关规定获得基金管理费及其它约定和法定的收入；
- 3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 4) 有关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

- 1) 依法募集基金，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) 办理基金备案手续；
- 3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记帐，进行证券投资；
- 6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7) 依法接受基金托管人的监督；
- 8) 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；
- 9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；编制半年度和年度基金报告；
- 10) 采取适当、合理的措施，使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的

方法符合基金合同等法律文件的规定，并按有关规定计算和公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行与基金财产管理业务活动有关的信息披露及报告义务；

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

13) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

14) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

17) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18) 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；

19) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或实施其它法律行为；

20) 有关法律法规和基金合同规定的其它义务。

## **2、基金托管人的权利与义务**

### **(1) 基金托管人的权利**

- 1) 获得基金托管费；
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3) 有关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**

- 1) 安全保管基金财产；
- 2) 对所托管的不同基金财产分别设置帐户，确保基金财产的完整与独立；

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，负责基金财产托管事宜；

4) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；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；

5) 按规定开设基金财产的资金帐户和证券帐户；

6) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

9) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

10) 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；

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

12) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

13) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

14) 建立并保存基金份额持有人名册；

15) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；

16) 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；

17) 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；

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

19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；



20) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

#### （1）基金份额持有人权利

每份基金份额具有同等的合法权益。基金份额持有人享有下列权利：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （2）基金份额持有人义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- 5) 返还持有基金份额过程中获得的不当得利；
- 6) 有关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

（1）需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 变更基金类别；

- 2) 变更基金投资目标、范围或策略;
- 3) 变更基金份额持有人大会程序;
- 4) 终止基金合同, 但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外;
- 5) 转换基金运作方式;
- 6) 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;
- 7) 更换基金管理人、基金托管人;
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

(2) 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费;
- 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) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## 2、召集人和召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起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, 应当由基金托管人自行召集。

(4) 代表基金份额 10%以上 (含 10%) 的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收

到书面提议之日起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%（含 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。

（5）如在上述第 4 条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

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

### 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，在至少一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。

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

#### 4、会议召开的的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场参加会议，不影响该次基金份额持有人大会决议的有效性。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

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

（2）通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 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。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场监督，则召集人可仅在公证机关的监督下收取书面表决意见，而不影响通讯开会方式的有效性；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 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份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大变更、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 30 天的间隔期。

基金份额持有人大会的召集人发出以通讯方式开会的通知后，该次基金份额持有人大会不得增加、减少或修改需由该次基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

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。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以

就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。

## （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下列第七条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所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后两个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同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，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## 7、计票

### （1）现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

计票过程应由公证机关予以公证。

### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。若基金托管人（或基金管理人）授权代表经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机关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决议应当由会议召集人自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

### （三）基金合同的变更与终止

#### 1、基金合同的变更

（1）变更下列基金合同的内容，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，应先召开基金份额持有人大会，决议通过后方可变更。

- 1) 变更基金类别；
- 2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3) 变更基金份额持有人大会程序；
- 4) 终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；
- 5) 转换基金运作方式；
- 6) 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；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

（2）出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会，而是由基金管理人和基金托管人同意变更并报中国证监会备案后公布。

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 因相应的法律法规发生变动并且本基金合同必须遵照进行变更；
- 3) 基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 4) 基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### 2、基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；



- (2) 基金管理人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- (3) 基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- (4) 基金合同约定的其他情形。

#### （四）争议的处理

基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人之间没有达成书面仲裁协议的，可以向有管辖权的人民法院起诉。

#### （五）基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

本基金合同自生效之日对本基金合同当事人具有同等的法律约束力。

本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和银行业监管机构各 2 份外，基金管理人和基金托管人各持有 2 份。每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册并对外公开散发或供投资人在有关场所查阅，但应以基金合同正本为准。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：巨田基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层

邮政编码：518033

法定代表人：王一楠

成立时间：2003 年 3 月 3 日

注册资本：人民币 1 亿元

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]33 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：50 年

经营范围：基金管理和发起设立基金

#### 2、基金托管人

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

邮政编码：100045

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

批准设立机关：中华人民共和国国务院

批准设立文号：国函[1992]7 号

组织形式：股份制商业银行

营业期限：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；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；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国人民银行和国家外汇管理局批准的其他业务。

## （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）根据《基金法》、基金合同、本协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、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、基金费用的支付、基金申购资金的到帐和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金的基金合同生效之后6个月开始。

（2）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规规定的行为，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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人对于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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

（3）基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 2、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

（1）根据《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息帐户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（2）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帐管理、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并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。

（3）基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规的规定，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。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。

（4）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

### **3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助**

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）基金财产保管**

### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金托管人依法持有基金财产，应安全保管所收到的基金的全部财产。基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人必须为基金设立独立的帐户，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帐管理。

（3）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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

（4）对于因为基金投资产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。

(5) 对于基金申（认）购过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知基金托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。

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

## 2、募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金认购专户。基金设立募集期满，由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。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中。

若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## 3、基金的银行帐户的开设和管理

在集中帐户托管模式下，基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用帐户。该帐户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。在分散帐户托管模式下，基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金银行存款帐户。

基金托管专户和基金银行帐户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何银行帐户；亦不得使用基金的任何帐户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户和基金银行帐户的管理应符合《银行帐户管理办法》、《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》以及中国人民银行的其它规定。

## 4、基金证券帐户、证券交易资金帐户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上

海分公司/深圳分公司开设证券帐户。

基金证券帐户的开立和使用，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对方同意擅自转让基金的任何证券帐户；亦不得使用基金的任何帐户进行本基金业务以外的活动。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金帐户，用于证券清算。

#### **5、债券托管乙类帐户的开设和管理**

(1) 基金合同生效后，基金管理人负责向中国证监会和中国银行业监督管理委员会申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易帐户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类帐户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2) 同业拆借市场交易帐户和债券托管帐户根据中国银行业监督管理委员会、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### **6、基金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；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上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

#### **7、与基金财产有关的重大合同的保管**

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责签署。签署时应保证基金一方持有 2 份以上正本，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先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。

#### **(四) 基金资产净值计算和会计核算**

## 1、基金资产净值的计算和复核

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基金总份额后的价值。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，盖章并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式传送给基金管理人，由基金管理人对外发布基金净值公告。

本基金按以下方式进行估值：

（1）上市流通的股票按估值日的收盘价计算；该日无交易的，以最近一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股票估值日的收盘价计算，该日无交易的，以最近一日的收盘价计算；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（如可转换债券）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和未上市债券按购入时不含利息的成本估值；

（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）未上市的其他证券以其成本价计算；

（9）派发的股息红利、债券利息以除权日为止的应获得额计算；

（10）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；

（11）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。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

## 2、净值差错处理

本基金基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后4位，国家另有规定的从其规定。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，视为基金份额净值计价错误。

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金管理人确认已经发生计价错误情形时，基金管理人应立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。计价错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

因发生差错造成基金份额持有人损失的，由基金管理人负责赔偿，赔偿原则如下：

- （1）赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失；
- （2）基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；
- （3）基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给每一单一当事人造成10元人民币以上的损失；
- （4）基金管理人在赔偿基金份额持有人后，有权向有关责任方追偿。

## 3、基金帐册的建立与核对

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记帐方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套帐册，对相关各方各自的帐册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处



理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对帐发现相关各方的帐目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的帐册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错帐的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的帐册为准。

#### 4、基金财务报表与定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

在本基金的基金合同生效后每6个月结束之日起45日内，基金管理人对招募说明书更新一次。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后60日内完成半年度报告编制并公告；在会计年度结束后90日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在2个工作日内立即进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后5个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后10个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后15个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的帐务处理方式为准。

核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、更新招募说明书、半年度报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### （五）基金份额持有人名册的登记和保管

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限公司担任本基金的注册登记人，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由注册登记人承担，但基金管理人应保证基金份额持有人名册的真实性、准确性和完整性。

基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日、每月最后一个交易日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册，由注册登记人编制，由基金管理人审核并交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供，但基金托管人应保证不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

涉及到基金份额持有人名册的所有费用，应从注册登记费用中支取，不得从基金财产中列支，也不得向基金托管人另外收取。

基金托管人和注册登记人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### （六）争议处理和法律适用

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改和终止

1、本协议相关各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。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）基金合同终止；

（2）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《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十二、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。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、场外投资人。每次交易结束后，可在 T+2 日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；每季度结束后 15 个工作日内，注册登记人或基金管理人向本季度有交易的场外投资人寄送对帐单；每年度结束后 30 个工作日内，注册登记人或基金管理人向所有持有本基金份额的场外投资人寄送对帐单。

2、场内投资人。每次交易结束后，可在 T+1 日后到交易网点进行确认单的查询和打印，注册登记人和基金管理人并不寄送场内投资人的对帐单，投资人可随时到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务手段查询。

### （二）网上交易服务

在技术条件成熟时，基金管理人可为投资人提供网上交易服务，具体实施方法由基金管理人另行公告。

### （三）信息咨询、查询服务

投资人如果想查询认购、申购和赎回等交易情况、基金帐户余额、基金产品与服务等信息，请拨打巨田基金管理有限公司客户服务中心电话 400-8888-668 或登录巨田基金管理有限公司网站（<http://www.jtfund.com>）进行咨询、查询。

基金管理人为投资人预设基金查询密码，预设的基金查询密码为投资人开户证件号码的后 6 位数字，不足 6 位数字的，前面加“0”补足。基金查询密码用于投资人查询基金帐户下的帐户和交易信息。投资人请在其知晓基金帐号后，及时拨打巨田基金管理有限公司客户服务中心电话修改基金查询密码。

### （四）基金红利再投资

本基金收益分配时，场外基金份额持有人可以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，并免收申购费用。

#### （五）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可通过销售机构为场外投资人提供定期定额投资的服务。通过定期投资计划，投资人可以定期定额申购基金份额，具体实施方法由基金管理人另行公告。

#### （六）服务联系方式

网址：<http://www.jtfund.com>

电子信箱：[jutian@jtfund.com](mailto:jutian@jtfund.com)

客户服务电话：400-8888-668

传真：（0755）8299 0911

投资人也可登录基金管理人网站，通过“客户服务”和“理财顾问”栏目，直接提出有关本基金的问题和建议。

## 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本基金管理人、基金托管人和销售代理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

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。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.jtfund.com](http://www.jtfund.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十四、备查文件

- （一）中国证监会核准巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；
- （二）《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （三）《巨田资源优选混合型证券投资基金登记结算服务协议》；
- （四）《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （五）法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

巨田基金管理有限公司

二〇〇五年八月五日