

# 光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）

## 重要提示

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2004 年 6 月 11 日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]85 号文核准公开募集。本基金份额于 2004 年 7 月 20 日至 8 月 20 日发售，本基金合同于 2004 年 8 月 27 日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购本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。

本更新招募说明书所载内容截止日 2011 年 8 月 26 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日。

中国光大银行股份有限公司于 2011 年 9 月 13 日复核了本次招募说明书更新。

## 目 录

一、	绪言 .....	1
二、	释义 .....	2
三、	基金管理人 .....	5
四、	基金托管人 .....	16
五、	相关服务机构 .....	18
六、	基金的募集 .....	33
七、	基金合同的生效 .....	33
八、	基金份额的申购与赎回 .....	33
九、	定期定额申购业务 .....	40
十、	基金的转换 .....	42
十一、	基金的投资 .....	45
十二、	基金的业绩 .....	59
十三、	基金的财产 .....	60
十四、	基金资产的估值 .....	61
十五、	基金的收益分配 .....	65
十六、	基金的费用与税收 .....	66
十七、	基金的会计与审计 .....	68
十八、	基金的信息披露 .....	69
十九、	风险揭示 .....	73
二十、	基金的终止与清算 .....	75

二十一、	基金合同的内容摘要 .....	77
二十二、	基金托管协议的内容摘要 .....	88
二十三、	对基金份额持有人的服务 .....	96
二十四、	其他应披露事项 .....	97
二十五、	招募说明书的存放及查阅方式 .....	98
二十六、	备查文件 .....	99

## 一、 绪言

本招募说明书由光大保德信基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其它有关规定编写。

本招募说明书阐述了光大保德信量化核心证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。招募说明书主要向投资人披露与本基金相关事项的信息，是投资人据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。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

在本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

基金或本基金：指光大保德信量化核心证券投资基金；

基金合同或本基金合同：指《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》及对该合同的任何修订和补充；

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；

《证券法》：指 2005 年 10 月 27 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订；

《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日由中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，于 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》；

《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》；

《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》；

《信息披露办法》：指 2004 年 6 月 8 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》；

招募说明书或本招募说明书：指《光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书》及其任何有效修订与更新；

法律法规及相关规定：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方性法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规及相关规定的不时修订和补充；

基金份额发售公告：指《光大保德信量化核心证券投资基金基金份额发售公告》；

托管协议：指《光大保德信量化核心证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充；

销售代理协议：指基金管理人和各基金代理销售机构签订的《光大保德信量化核心证券投资基金销售与服务代理协议》及对该协议的任何修订和补充；

**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/本基金管理人/本公司：**指光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）；

**基金托管人：**指中国光大银行；

**销售机构：**指负责开放式基金销售的直销机构和代销机构；

**直销机构（网点）：**指光大保德信基金管理有限公司；

**代销机构（网点）：**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；

**注册登记人：**指办理注册登记业务的机构，本基金注册登记人为光大保德信基金管理有限公司，具体业务由光大保德信基金管理有限公司登记结算中心负责实施；

**基金销售业务：**指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务；

**注册登记业务：**指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户的建立管理、基金份额的注册登记、清算及交易确认、代理发放红利、建立保管基金份额持有人名册、基金交易的资金的清算与交收等；

**基金份额持有人：**指依本基金合同或依法取得并持有本基金基金份额的投资者；

**基金投资者：**指个人投资者和机构投资者和合格境外机构投资者；

**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：**指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资本基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及合格境外机构投资者；

**合格境外机构投资者：**指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的开放式证券投资基金的中国境外的机构投资者；

**募集期：**指自基金份额发售之日起到认购截止的时间段，最长不超过 3 个月；募集期已在本基金的发售公告中列明；

基金合同生效日：指基金达到本基金合同规定的条件后，本基金合同由中国证监会确认备案的日期；

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

存续期：指基金合同生效之日至基金合同终止之日的不定期期限；

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；

工作日：上海证券交易所及深圳证券交易所的正常交易日；

T日：指销售机构在规定时间受理投资者业务申请的工作日；

T+N日：指自T日起第N个工作日（不包括T日）；

日/天：指公历日；

月：指公历月；

认购：在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买基金份额的行为；

申购：在基金合同生效后，投资者按照基金合同的规定申请购买基金份额的行为；

赎回：在基金合同生效后，投资者按照基金合同的规定，通过基金销售机构申请将手中持有的基金份额按一定价格卖给基金管理人并收回现金的行为；

巨额赎回：开放式基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日该基金总份额的10%时，称为巨额赎回；

转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；

转托管：指基金份额持有人将其所持有的某一基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；

定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；

基金账户：注册登记人为投资者开立的用于记录投资者持有基金份额余额及其变动情况的账户；

基金交易账户：销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖基金份额、基金份额变动及资金结余情况的账户；

元：指人民币元；

投资指令：指基金管理人在运用基金资产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

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资产所形成的价值总和；

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；

基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数；

基金份额持有人服务：指基金管理人承诺为基金份额持有人提供的一系列服务；

信息披露媒体或指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人的网站；

不可抗力：指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括但不限于：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：光大保德信基金管理有限公司

成立日期：2004年4月22日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42号

注册地址：上海市延安东路222号外滩中心大厦46层

办公地址：上海市延安东路222号外滩中心大厦46层

法定代表人：林昌

注册资本：人民币1.6亿元

股权结构：光大证券股份有限公司（以下简称“光大证券”）持55%的股权  
保德信投资管理有限公司持45%的股权

电话：(021) 33074700

传真：(021) 63351152



客服电话：400-820-2888；(021) 53524620

联系人：张弛

网址：www.epf.com.cn

## (二) 主要人员情况

### 1. 董事会成员

林昌先生，董事长，北京大学硕士，中国国籍。历任光大证券南方总部研究部总经理、投资银行一部总经理、南方总部副总经理、投资银行总部总经理、光大证券助理总裁。现任本基金管理人董事长。

Christopher Cooper(克里斯托弗·库珀)先生，董事，美国芝加哥大学商学院工商管理硕士，美国国籍。历任保德信国际投资有限公司执行董事、保德信投资证券有限公司总裁兼首席执行官、保德信国际投资有限公司亚洲区总裁。现任保德信国际投资业务总裁。

傅德修先生，董事，美国哥伦比亚大学硕士，中国（香港）国籍。曾任富达基金管理公司（Fidelity）业务总监，瑞士银行瑞银环球资产管理公司（UBS）执行董事暨大中国区主管，友邦华泰基金管理有限公司总经理。现任本基金管理人总经理。

沈诗光先生，董事，东北财经大学硕士，中国国籍。历任光大证券计财部高级经理、财务处处长、计财部副总经理。现任光大证券计财部总经理。

何媛媛女士，董事，上海交通大学企业管理专业博士，中国国籍。历任华夏证券研究所行业部经理、副所长，中信建投证券有限责任公司研究发展部副总经理。现任光大证券研究所副所长。

夏小华先生，独立董事，复旦大学政治经济学系学士，中国国籍。历任交通银行研究开发部经济研究处处长、研究开发部副总经理，广东发展银行上海分行常务副行长、行长、党委书记。现任华夏银行上海分行行长。

金德环先生，独立董事，上海财经大学硕士、教授，中国国籍。曾任上海财经大学财政金融系教研室主任、财政系副主任、证券期货学院副院长。现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。

郑志先生，独立董事，华东政法学院（现华东政法大学）法律史专业硕士。曾任安徽国运律师事务所上海分所律师、国浩律师集团（上海）事务所律师、上海东方华银律师事务所合伙人及律师。现任北京市大成律师事务所上海分所律

师。

## 2. 监事会成员

李海松先生，监事长，光大证券股份有限公司监事、风险管理部副总经理。历任南方证券有限公司营业部业务经理，中国光大银行股份有限公司深圳证券营业部副总经理，光大证券武汉、深圳证券营业部总经理、经纪业务总部副总经理。

颜微滢女士，监事，新加坡国立大学经济和数学双学士，马来西亚国籍，香港证券业协会会员。历任新加坡 Farenw Mondial 投资私人有限公司分析员，DBS 唯高达亚洲有限公司合规经理，香港交易所上市部副总监，富通集团亚洲区域合规总监。现任香港保德信亚洲基金管理有限公司董事及首席合规总监。

张力先生，监事，香港城市大学工商管理硕士，中国国籍。曾就职于普华永道中天会计师事务所有限公司，2004 年初加入光大保德信基金管理有限公司并参与公司的开业工作。现任本基金管理人财务部总监。

## 3. 公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长，简历同上。

傅德修先生，现任本基金管理人总经理，简历同上。

盛松先生，北京大学硕士，中国国籍。历任中国光大国际信托投资公司证券部交易部经理，光大证券资产管理总部总经理，2003 年参加光大保德信基金管理有限公司筹备工作。现任本基金管理人的督察长。

梅雷军先生，吉林大学机械系博士，武汉大学机械系学士。基金从业人员资格。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司投资管理部经理，光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理、光大证券电子商务一部总经理、信息技术部总经理兼客户服务中心总经理。2004 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任本基金管理人副总经理兼首席运营总监。

张弛先生，CFA，英国兰卡斯特大学（Lancaster University）金融学硕士。曾任建设银行上海分行信贷员，华安基金管理有限公司高级产品经理、战略策划部总监助理。加入光大保德信基金管理有限公司后，先后担任产品总监、市场与产品总监、代理首席市场总监、首席市场总监，现任本基金管理人副总经理兼首

席市场总监。

#### 4. 基金经理

历任基金经理：

何如克先生，与常昊先生共同担任本基金基金经理时间为 2004 年 8 月 27 日至 2005 年 8 月 6 日。

常昊先生，担任本基金基金经理时间为 2004 年 8 月 27 日至 2007 年 6 月 28 日。

袁宏隆先生，担任本基金基金经理时间为 2007 年 6 月 29 日年至 2011 年 4 月 25 日。

现任基金经理：

钱钧先生，硕士。毕业于南京大学国际工商管理学院，获工商管理硕士学位，曾在联合证券担任高级研究员，在西部证券担任投资经理助理等工作，现任本基金管理人权益投资总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

#### 5. 投资决策委员会成员

傅德修先生，现任本基金管理人董事兼总经理。

周炜炜先生，现任本基金管理人首席投资总监兼光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理。

高宏华女士，现任光大保德信新增长股票型证券投资基金基金经理。

钱钧先生，现任本基金管理人权益投资总监、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

凌超先生，现任光大保德信货币市场基金基金经理。

陆欣先生，现任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理兼光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理。

王健女士，现任光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

于进杰先生，现任光大保德信红利股票型证券投资基金基金经理。

吴育霖先生，现任本基金管理人 QDII 投资总监。

黄素丽女士，现任光大保德信均衡精选股票型证券投资基金基金经理。

戴奇雷先生，现任本基金管理人研究总监。

李阳先生，现任光大保德信中小盘股票型证券投资基金基金经理。

上述人员无近亲属关系。

### **(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. 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. 编制基金季度报告、基金半年度报告和基金年度报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 中国证监会规定的其他职责。

### **(四) 基金管理人的承诺**

1. 基金管理人承诺严格遵守法律、法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资；
2. 基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下法律法规禁止的行为发生：
  - (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) 向本基金管理人、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) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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) 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；
- (9) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (10) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (11) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失
- (12) 法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

3. 本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、有误导、欺诈成份；
- (10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规、基金合同及基金管理人有关投资制度的规定，本着审慎勤勉的原则，充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则为基金份额持有人谋取

最大利益；

- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不担任基金托管人或其他基金管理人的任何职务，不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的任何行为，并遵纪守法。

## **(五) 基金管理人的内部控制制度**

### **1. 内部控制概述**

内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的有机系统。

内部控制是由为保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度构成的统一整体。

内部控制是由公司董事会、管理层和员工共同实施的合理保证。公司内部控制要达到的总体目标是：

- (1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；
- (2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；
- (3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时；
- (4) 确保公司成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

### **2. 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**

控制环境是内部控制其它要素的基础，它决定了公司的内部控制基调，并影响着公司员工的内控意识。为此，本基金管理人从两方面入手营造一个好的控制

环境。首先，从“硬控制”来看，本基金管理人遵循健全的法人治理结构原则，设置了职责明确、相互制约的组织结构，各部门有明确的岗位设置和授权分工，操作相互独立。其次，公司更注重“软控制”，公司管理层牢固树立内部控制和风险管理优先的理念和实行科学高效的运行方式，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，加强全体员工道德规范和自身素质建设，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

## **(2) 风险评估**

本基金管理人的风险评估和管理分三个层次进行：一，全公司各部门进行风险的自我评估和分析，通过制定相应的控制措施进行自我风险管理。二，公司管理层下的风险管理工作委员会负责风险管理工作，设定明确的风险管理目标，建立科学严密的风险控制评估体系，辨认和识别公司内外部的重大风险，评估和分析风险的重大性、制定相应的风险控制方案和有效防范措施。风险管理工作委员会通过定期与不定期风险评估及时防范和化解风险。三，董事会专门委员会——风险管理委员会负责公司全面风险管理工作，监控和评价管理层的风险管理工作，并决策重大的风险管理事项。

## **(3) 控制活动**

本基金管理人制定了各项规章制度，通过各种预防性的、检查性的和修正性的控制措施，把控制活动贯穿于公司经营活动的始终。尤其是强调对于基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；严格岗位分离，明确划分各岗位职责，明确授权控制；对重要业务部门和岗位进行了适当的物理隔离；制订应急应变措施，危机处理机制和程序。

## **(4) 信息沟通**

本基金管理人建立清晰、有效的垂直报告制度和平行通报制度，以确保识别、收集和交换有关运营活动的关键指标，使员工了解各自的工作职责和公司的规章制度，并建立与客户和第三方的合理交流机制。

## **(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地监督，保证内部控制制度的落实。各部门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。

### 3. 公司的内部控制原则

(1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则：通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行。

(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、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 4. 内部控制机制

内部控制机制是指公司的组织结构及其相互之间的制约关系。内部控制机制是内部控制的重要组成，健全、合理的内部控制机制是公司经营活动得以正常开展的重要保证。

从功能上划分，公司的内部控制机制可分为“决策系统”、“执行系统”、“监督系统”三个方面。监督系统在各个内部控制层次上对决策系统和执行系统实施监督。

决策系统是指在公司经营管理过程中拥有决策权力的有关机构及其之间的关系。执行系统是指具体负责将公司决策系统的各项决议付诸实现的一些职能部门。

执行系统在总经理办公会的直接领导下，承担了公司日常经营管理、基金投资运作和内部管理工作。

监督系统对公司的决策系统、执行系统进行全程、动态的监控，监督的对象覆盖公司经营管理的全部内容。公司监督系统从监督内容划分，大致分为三个层次：

- (1) 监事会——对董事、公司高管人员的行为及董事会的决策进行监督；
- (2) 董事会专门委员会及督察长——根据董事会的授权对公司的经营活动进行



监督；

(3) 监察稽核部——根据总经理及督察长的安排，对公司经营活动及各职能部门进行的内部监督。

## 5. 内部控制层次

(1) 员工自律和部门主管的监控。公司所有员工上岗前必须经过岗位培训，签署自律承诺书，保证遵守国家的法律法规以及公司各项管理制度；保证良好的职业操守；保证诚实信用、勤勉尽责等。公司各部门主管在权限范围之内，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定、公司的业务规范和守则，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任。

(2) 公司管理层的控制。公司管理层采取各种控制措施，管理和监督公司各个部门和各项业务进行，以确保公司运作在有效的控制下。公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

(3) 董事会及其专门委员会的监控和指导。公司所有员工应自觉接受并配合董事会及其专门委员会对各项业务和工作行为的检查监督。合理的风险分析和管理建议应予采纳，公司规定的风险控制措施必须坚决执行。董事会对内部控制负最终责任。

督察长和监察稽核部负责对公司内部控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的检查和评价。

## 6. 内部控制制度

公司内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和义务规则，是公司内部控制的重要组成部分。内部控制制度的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次：

(1) 《公司章程》——指经股东会批准的《公司章程》，是公司制定各项基本管理制度和具体管理规章的基本依据；

(2) 内部控制大纲——是对公司章程规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽；

(3) 公司基本管理制度——是公司在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。公司基本管理制度包括但不限于风险管理制、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露管理办法、监察

稽核制度、信息技术管理制度、公司自有资金投资内部控制制度、公司财务制度、档案管理制度、印章管理办法、行政管理制度、人力资源管理制度、业绩评估考核制度、员工对外兼职管理办法、员工行为规范、纪律程序和应急情况处理与业务连续制度等。

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。它不仅是公司业务、管理、监督的需要，同时也是避免工作中主管随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改，经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

## **7. 基金管理人关于内部控制的声明**

本公司确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，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) 基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司（简称“中国光大银行”）

住所地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号光大中心

成立日期：1992年8月18日

注册资本：人民币404.3479亿元

法定代表人：唐双宁

联系人：石立平

电话：010-63639180

传真：010-63639132

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

### (二) 主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任（主持工作），中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长，中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记，中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记，中国人民银行信贷管理司司长，中国人民银行货币金银局局长，中国人民银行银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记，中国光大银行董事长、党委书记，光大证券股份有限公司董事长，中国光大控股有限公司董事会主席，中国光大国际有限公司董事会主席。

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。

陈昌宏先生，北京大学法学学士、硕士。曾任中共中央联络部干部，四川光

大资产管理公司董事、常务副总经理，中国光大银行昆明分行副行长。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

### **(三) 基金托管业务经营情况**

截止 2011 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司共托管国投瑞银融华债券型基金、摩根士丹利华鑫基础行业基金、国投瑞银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成货币市场基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型基金（LOF）、招商安本增利债券型基金、国投瑞银创新动力基金、大成策略回报股票型基金、博时转债增强型债券型基金、中欧新动力股票型基金，共 12 只证券投资基金，托管基金资产规模 380.37 亿元。同时，开展了证券公司集合理财计划、专户理财、企业年金基金、QDII 等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### **(四) 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**

中国光大银行董事会下设风险管理委员会、审计委员会，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、各类业务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部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。基金托管部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

#### **4. 内部控制制度**

中国光大银行投资与托管业务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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》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》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》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、交易监控）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

#### **(五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序**

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，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，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。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话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。

### **五、 相关服务机构**

#### **(一) 直销机构**

名称：光大保德信基金管理有限公司上海投资理财中心

地址：上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层

电话：（021）63352934，63352937

传真：（021）63350429

客服电话：400-820-2888；（021）53524620

联系人：刘佳、戴小娟

网址：www.epf.com.cn

## （二） 代销机构

### 1. 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客服电话：95533

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com

### 2. 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

### 3. 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

#### **4. 中国邮政储蓄银行有限责任公司**

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

客服电话：95580

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

#### **5. 中国光大银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：薛军丽

电话：010-63636150

传真：010-63636157

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

#### **6. 招商银行股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

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

#### **7. 中国民生银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：董云巍

电话：010-57092615

传真：010-57092611

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

#### **8. 上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

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

#### **9. 中信银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：丰靖

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

#### **10. 兴业银行股份有限公司**

注册地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：(021) 52629999

联系人：刘玲

客服电话：95561

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

#### **11. 北京银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：阎冰竹



联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客服电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

## **12. 宁波银行股份有限公司**

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客服电话：96528

网址：www.nbcb.com.cn

## **13. 平安银行股份有限公司**

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客服电话：40066-99999、0755-961202

网址：www.pingan.com

## **14. 华夏银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

## **15. 广东发展银行股份有限公司**

注册地址：广东省广州市农林下路 83 号

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

客服电话：0571-96000888, 020-38322222

网址: www.gdb.com.cn

#### **16. 上海农村商业银行股份有限公司**

注册地址: 上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15—23 层

法定代表人: 胡平西

客服电话: 021-962999

联系人: 吴海平

电话: 021-38576977

网址: www.srcb.com

#### **17. 东莞农村商业银行股份有限公司**

注册地址: 东莞市南城路 2 号

办公地址: 东莞市南城路 2 号

法定代表人: 何沛良

客服电话: 0769-961122

联系人: 黄飞燕

电话: 0769-23394102

传真: 0769-22320896

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

#### **18. 浙江稠州商业银行股份有限公司**

注册地址: 浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址: 浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

法定代表人: 金子军

客服电话: (0579)96527、4008096527

联系人: 董晓岚、邵利兵

电话: 0571-87117617、87117616

传真: 0571-87117616

网址: www.czcb.com.cn

#### **19. 光大证券股份有限公司**

注册地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服电话：4008888788、10108998、95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

## **20. 海通证券股份有限公司**

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553、4008888001

联系人：金芸

网址：www.htsec.com

## **21. 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 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960223

传真：0755-82943100

客服电话：95565、4008888111

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

## **22. 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：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客服电话：4008888666

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

### **23. 山西证券股份有限公司**

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：侯巍

电话：(0351) 8686703

传真：(0351) 8686619

客服电话：400-666-1618

联系人：孟婉婷

网址：www.i618.com.cn

### **24. 平安证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：(0755) 22626172

传真：(0755) 82400862

客服电话：4008816168

网址：www.pingan.com

### **25. 中信金通证券有限责任公司**

注册地址：杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客服电话：(0571) 96598

传真：(0571) 85783771

联系人：丁思聪

网址：www.bigsun.com.cn

### **26. 广发证券股份有限公司**

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316)

房)

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

客服电话：95575 或致电各地营业网点

传真：(020) 87555305

网站：www.gf.com.cn

### **27. 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：邓寒冰

电话：021-54046657

传真：021-54038844

客服热线：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

### **28. 中信建投证券有限责任公司**

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108 (免长途费)

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

### **29. 中信万通证券有限责任公司**

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河  
电话：(0532) 85022326  
传真：(0532) 85022605  
联系人：吴忠超  
网址： [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

### **30. 东方证券股份有限公司**

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层—29 层  
办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层—29 层  
法定代表人：王益民  
电话：(021) 63325888  
传真：(021) 63327888  
客服电话：(021) 95503  
联系人：吴宇  
网址： [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

### **31. 湘财证券有限责任公司**

地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼  
法定代表人：林俊波  
电话：021-68634518  
传真：021-68865680  
联系人：钟康莺  
网址： [www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

### **32. 国元证券股份有限公司**

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
法定代表人：凤良志  
电话：0551-2246298  
传真：0551-2272100  
联系人：李飞  
客服电话：4008-888-777

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

### **33. 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) 38565783

客服电话：400-8888-123

联系人：谢高得

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

### **34. 中国银河证券股份有限公司**

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：顾伟国

传真：010-66568116

客服电话：400-888-8888

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

### **35. 安信证券股份有限公司**

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

办公地址：深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

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

### **36. 上海证券有限责任公司**

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：蒋元真

联系电话：021-51539888

联系人：谢秀峰

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

客服电话：021-962518

**37. 齐鲁证券有限公司**

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网站：www.qlzq.com.cn

**38. 华泰联合证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

客服电话：95513

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

**39. 宏源证券股份有限公司**

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

**40. 浙商证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

电话：(0571)87901963

联系人：吴颖

客服电话：0571-87902079

网址：www.stocke.com



#### **41. 国信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

#### **42. 华泰证券股份有限公司**

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290979

传真：025-84579763

联系人：万鸣

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

#### **43. 中信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

电话：(0755) 83073087

传真：(0755) 83073104

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

#### **44. 信达证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

#### **45. 天相投资顾问有限公司**

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

网站：www.txsec.com 或 www.txjijin.com

#### **46. 华福证券有限责任公司**

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7--10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

客服电话：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

#### **47. 中国建银投资证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层  
至 21 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层  
至 21 层

法定代表人：杨明辉

联系人：刘毅

联系电话：0755-82023442

客服电话：4006008008

网址：www.cjis.cn

#### **48. 江海证券有限公司**

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：徐世旺  
联系电话：0451-82336863  
传真：0451-82287211  
客服电话：400-666-2288  
网址：www.jhzq.com.cn

#### **49. 财富证券有限责任公司**

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼  
办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼  
法定代表人：周晖  
联系人：郭磊  
联系电话：0731-84403319  
传真：0731-84403439  
网址：www.cfzq.com

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。

#### **(三) 注册登记机构**

名称：光大保德信基金管理有限公司  
注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层  
法定代表人：林昌  
电话：(021) 63350651  
传真：(021) 63352652  
联系人：田晓枫

#### **(四) 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 39 号建外 SOHO A 座 31 层  
办公地址：深圳市深南东路 5002 号信兴广场地王商业中心 4708—4715 室  
法定代表人：王玲

电话：(0755) 82125533

传真：(0755) 82125580

联系人：宋萍萍

经办律师：靳庆军、宋萍萍

#### (五) 会计师事务所和经办注册会计师

公司全称：安永华明会计师事务所

注册地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼) 16层

办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：葛明

电话：021-24052000

传真：021-54075507

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、蒋燕华

## 六、 基金的募集

本基金募集期为 2004 年 7 月 20 日至 2004 年 8 月 20 日，本次募集的净销售金额为 2,543,673,964.24 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 613,251.70 元人民币。本次募集有效认购户数为 10,835 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息折算成基金份额共计 2,544,287,215.94 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

经中国证监会核准，本基金的基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效。

## 七、 基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、 基金份额的申购与赎回

### (一) 申购、赎回场所

本基金合同生效后,基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的(网点)进行(代销机构名称和住所等信息请见前文)。基金管理人可指定其他具有相应条件的基金代销机构办理基金份额申购与赎回业务。

同时,在国内的电子支付与结算和其他相关技术成熟后,基金投资者可通过本基金管理人或者指定的基金代销机构进行电话、传真或互联网等形式的申购与赎回。

本基金已开通网上交易业务,相关公告见 2006 年 1 月 16 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站的《光大保德信基金管理有限公司关于推出开放式基金网上交易业务的公告》。

## (二) 申购、赎回开放日及开放时间

本基金已经开始办理日常申购和赎回等基金业务,办理申购与赎回等基金业务的时间(即开放日)为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日具体业务办理时间为:每个基金开放日的 9:30—15:00,交易日 15:00 以后接受的交易申请均作为下一个交易日的申请处理。

投资者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。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整,但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响,基金管理人将有关调整的公告同时报中国证监会备案,并最迟在实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (三) 申购与赎回的原则

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. 申购费用按单笔申购确认金额对应的费率和单笔确认的申购金额以“外扣法”计算而得;

4. 当日的申购和赎回申请可以在当日交易结束时间前撤消，在当日交易时间结束后不得撤消；
5. 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。基金管理人最迟于新规则开始实施日的 2 日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

#### **(四) 申购与赎回的程序**

1. 申请方式：基金投资者须按照基金销售机构的规定，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；提交赎回申请时，其在销售机构（网点）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，不予成交。
2. 申购、赎回的确认与通知：对在 T 日规定时间内受理的申请，在正常情况下，基金份额持有人可在 T+2 个工作日内到其办理申请业务的销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。
3. 申购、赎回款项的支付的方式与时间：基金申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未能全额到帐，则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项通常在 T+7 日内划往赎回人预留的银行帐户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照有关巨额赎回的条款处理。
4. 若投资者进行申购申请后，基金管理人发生灾害导致无法对申购人及其份额进行准确确认时，基金管理人会将所有申购款项退还至各销售机构，投资者可在基金管理人相关能力恢复后再次提交申购申请。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### **(五) 申购与赎回的数额限制**

1. 代销网点每个账户每次申购的最低金额为人民币 1,000 元；
2. 投资理财中心每个账户每次申购的最低金额为人民币 1,000 元；已在投资理财中心有认购本基金记录的基金份额持有人不受首次申购最低金额的限制；

3. 本基金对单个基金份额持有人持有基金份额的比例或数量不设限制,法律另有规定的除外;
4. 赎回的最低份额为 100 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交易账户的基金份额余额少于 100 份时,余额部分基金份额将由注册登记人发起强制赎回;
5. 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,基金管理人最迟在调整前 2 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;
6. 申购份额、余额的处理方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,以四舍五入的方法保留到小数点后两位;
7. 赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,以四舍五入的方法保留到小数点后两位。

## (六) 申购份额与赎回支付金额的计算方式

### 1. 基金申购份额的计算:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,计算公式如下:

申购价格 = 申购日基金份额净值

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购价格

### 2. 基金赎回金额的计算:

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用,计算公式如下:

赎回价格 = 申请日基金份额净值

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回价格

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

3. 申请日(T日)的基金份额净值在当天证券交易所收市后计算,并在下一交易日(T+1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。

基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值=基金资产净值总额/发行在外的基金份额总份数。

## **(七) 申购和赎回的注册登记**

基金投资者申购本基金成功后，基金注册登记人在T+1日为基金份额持有人登记权益并办理注册登记手续，基金投资者在T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金。基金份额持有人赎回本基金成功后，基金注册登记人在T+1日为基金份额持有人扣除权益并办理登记结算手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册与过户登记办理时间进行调整，但不得实质影响基金份额持有人的合法权益，并最迟于开始实施前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## **(八) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式**

### **1. 拒绝或暂停申购**

出现以下情况之一时，基金管理人可以拒绝或暂停接受、办理申购申请：

- (1) 不可抗力导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易所交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 因技术故障或人员伤亡导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购可能会损害已有基金份额持有人利益；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他拒绝或暂停接受申购申请的情形。

发生上述（1）至（3）项或（5）项情形时，基金管理人应立即报中国证监会备案，并及时在指定信息披露媒体上刊登暂停申购的公告。

发生上述（4）项情形时，基金管理人应将申购款项全额退还申购申请人。

### **2. 暂停接受和办理赎回申请**

出现以下情况之一时，基金管理人可以暂停接受或办理赎回申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；



(2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因，基金连续两个开放日以上（含本数）发生巨额赎回或在 10 个工作日内发生 3 次以上（含本数）巨额赎回；

(4) 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书中已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人将在当日立即向中国证监会备案并及时在指定信息披露媒体上刊登暂停赎回的公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，将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，其余部分在后续工作日予以兑付。

## **(九) 巨额赎回的情形及处理方式**

### **1. 巨额赎回的认定**

基金单个开放日，基金净赎回申请份额（净赎回申请份额=赎回申请份额+转出申请份额-申购申请份额-转入申请份额）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**

巨额赎回申请发生时，基金管理人可以根据本基金当时的现金情况决定全额赎回、部分延期赎回或者暂停赎回；

(1) 全额赎回：按正常的赎回程序办理；

(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，并以该开放日当日的基金资产净值为依据计算赎回金额，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，基金管理人应在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方式，同时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告，

并向中国证监会备案。

**暂停赎回：**本基金连续两个开放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的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒体上进行公告。

#### **(十) 其他暂停申购和赎回的情形及处理方式**

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停公告。暂停期间，基金管理人将每2周至少刊登提示性公告一次；暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应最迟提前2日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登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近一个工作日基金份额净值。

#### **(十一) 重新开放申购或赎回的公告**

1. 如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公布最新的基金份额净值。
2. 如果发生暂停的时间超过1天但少于两周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前1个工作日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。
3. 如果发生暂停的时间超过两周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前2日在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

#### **(十二) 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押**

##### **1. 非交易过户**

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一基金份额持有人基金账户转移到另一基金份额持有人基金账户的行为。

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时必须提供注册登记机构要求提供的相关资料并按基金注册登记人规定的标准支付费用。

## **2. 转托管**

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购(认购)基金份额，但在赎回的情况下，必须向原申购(认购)的销售机构申请办理相应部分基金份额的赎回手续。

投资者申购(认购)基金份额后可以向原申购(认购)基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者方可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

## **3. 冻结与质押**

基金注册登记人只受理司法机构及其他有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

在有关法律法规有明确规定的情况下，本基金将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，基金管理人将制定、公布、实施相应的业务规则。

## **九、 定期定额申购业务**

开放式基金定期定额申购业务是指投资者可通过基金销售机构提交申请，约定每月申购时间和申购金额，由销售机构于每月约定申购日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种投资方式。

### **(一) 定期定额申购业务适用投资者范围**

符合基金合同规定的所有个人投资者和机构投资者。

### **(二) 办理时间**

投资者可在基金开放日申请办理定期定额申购业务，具体办理时间与基金申

购、赎回业务办理时间相同。

### **(三) 销售机构**

投资者可通过中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中国光大银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、广东发展银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、浙江稠州商业银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、华泰联合证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、华福证券有限责任公司、江海证券有限公司相关营业网点办理本基金的定期定额申购业务。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

### **(四) 办理方式**

1. 申请办理定期定额申购业务的投资者须拥有光大保德信基金管理有限公司开放式基金账户，具体开户程序请遵循各销售机构规定；
2. 投资者开立基金账户后携带本人有效身份证件和有关凭证到指定的各销售机构网点申请办理光大保德信开放式基金的定期定额申购业务，具体办理程序请遵循各销售机构的有关规定。

### **(五) 扣款金额**

光大保德信量化核心证券投资基金投资者可与销售机构约定每月固定扣款金额，每月扣款金额不得低于人民币 100 元(含 100 元)，不设金额级差。

### **(六) 扣款日期**

1. 投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每月固定扣款日期；
2. 如果在约定的扣款日前投资者开办定期定额业务的申请得到成功确认，则首次扣款日为当月，否则为次月。

#### **(七) 扣款方式**

1. 销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日和扣款金额进行自动扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；
2. 投资者须指定一个销售机构认可的资金账户作为每月固定扣款账户；
3. 投资者账户余额不足则不扣款，请投资者于每月扣款日前在账户内按约定存足资金，以保证业务申请的成功受理。

#### **(八) 申购费率**

目前光大保德信量化核心证券投资基金的申购业务采取“前端收费”模式，故定期定额申购也只采取“前端收费”模式，如无另行公告，定期定额申购费率及计费方式等同于一般的申购业务。

#### **(九) 交易确认**

每月实际扣款日与基金申购申请日为同一日，以该日(T日)的基金单位资产净值为基准计算申购份额，申购份额将在T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户。投资者可自T+2工作日起查询定期定额申购成交情况。

#### **(十) 变更与解约**

如果投资者想变更每月扣款金额和扣款日期，可提出变更申请；如果投资者想终止定期定额申购业务，可提出解除申请，具体办理程序请遵循相关销售机构的规定。

### **十、 基金的转换**

#### **(一) 基金转换业务适用投资者范围**

已持有本公司管理的基金中任一只基金的投资者。

#### **(二) 销售机构**

投资者可通过本公司直销柜台、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中国光大银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司

司、中信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、广东发展银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、浙江稠州商业银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华泰联合证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、华福证券有限责任公司、江海证券有限公司、财富证券有限责任公司相关营业网点办理本基金与公司管理的其他基金之间的基金转换业务。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

### **(三) 基金转换办理时间**

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

### **(四) 基金转换费率**

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由申请办理该项业务的基金投资者承担。具体公式如下：

#### **1. 转出金额：**

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金单位资产净值

#### **2. 转换费用：**

如果转入基金的申购费率 < 转出基金的申购费率：

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率 + 转出金额 × (1 - 转出基金赎回费率) × 转出基金与转入基金的申购费率差 / (1 + 转出基金与转入基金的申购费率差)

如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率：

转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

各股票型基金在转换过程中转出金额对应的转出基金或转入基金申购费用为固定费用时，则该基金计算补差费率时的申购费率视为 0；

基金在完成转换后不连续计算持有期；

转出基金与转入基金的申购费率差为基金转换当日转出金额对应得转出基金和转入基金的申购费率之差。

具体赎回费率以及各基金申购费率差请参照相应的基金合同或相关公告。

### 3. 转入金额与转入份额：

转入金额=转出金额-转换费用

转入份额=转入金额÷转入基金当日基金单位资产净值

## (五) 基金转换规则

1. 基金转换只能在同一销售机构办理，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。
2. 基金转换采取“未知价”法，即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。
3. 基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位，单笔转换申请份额不得低于 1000 份，当单个交易账户的基金份额余额少于 1000 份时，必须一次性申请转换。
4. 当日的基金转换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. 转换费用实行外扣法收取，基金转换费用由基金持有人承担。

## (六) 基金转换的注册登记

1. 基金投资者提出的基金转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。
2. 基金份额持有人的基金转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为基金份额持有人申请进行确认，确认成功后为基金持有人办理相关的注册登记手续。
3. 本公司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，并按规定予以公告。

## **(七) 暂停基金转换的情形及处理**

出现下列情况之一时，基金管理人可以暂停接受基金持有人的基金转换申请：

1. 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
2. 证券交易场所在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. 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请；
4. 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时，基金管理人应按规定予以公告。

## **十一、基金的投资**

### **(一) 投资目标**

追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

### **(二) 投资理念**

- 以量化投资为核心的理性投资管理
- 以控制风险为前提的积极投资管理
- 以稳健收益为目标的长期投资管理

### **(三) 投资方向**

本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。



#### (四) 投资策略

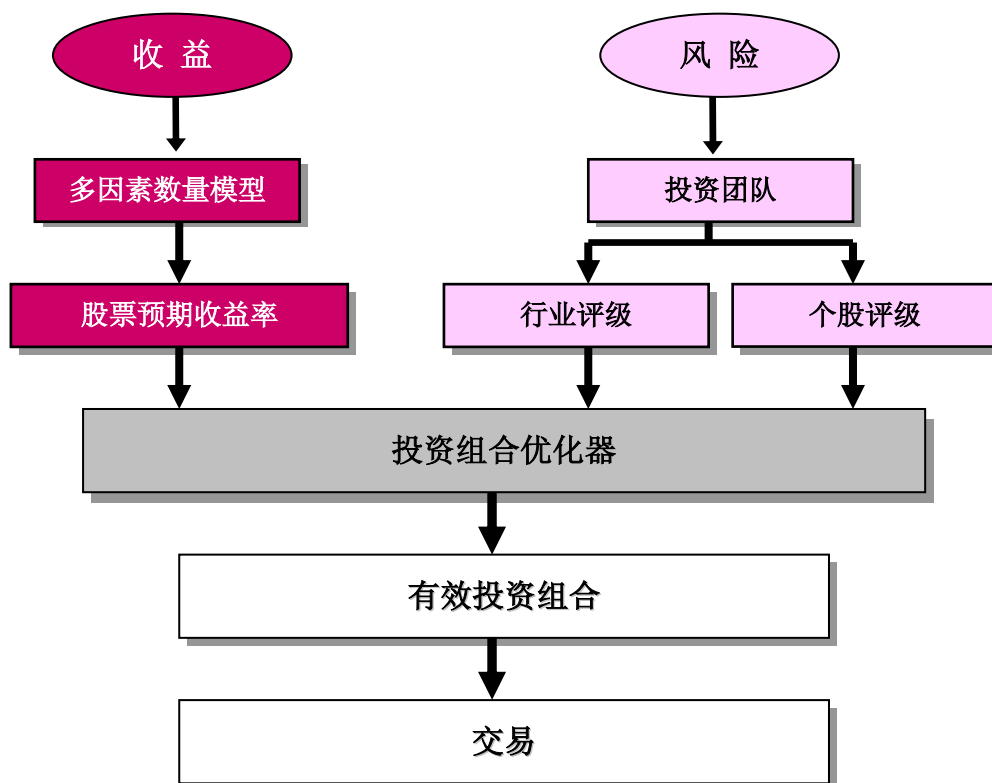
本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，形成光大保德信独特的量化投资策略；正常市场情况下不作主动资产配置，采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票；并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。

本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5—15%。

本基金建仓时间为 6 个月，基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。

针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指 10 个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。

本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。具体流程如下图所示：



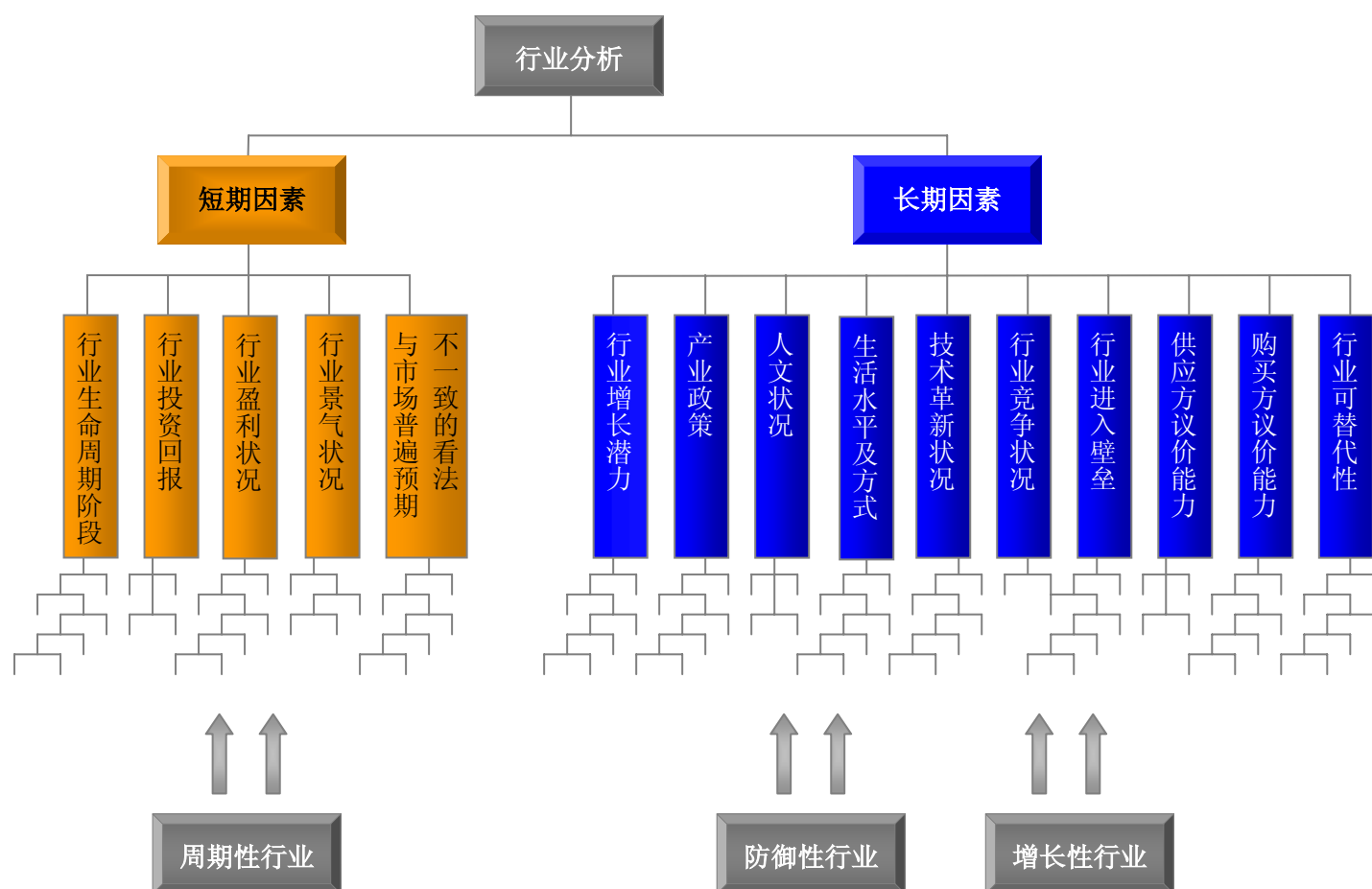
## 1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

## 2. 行业评级

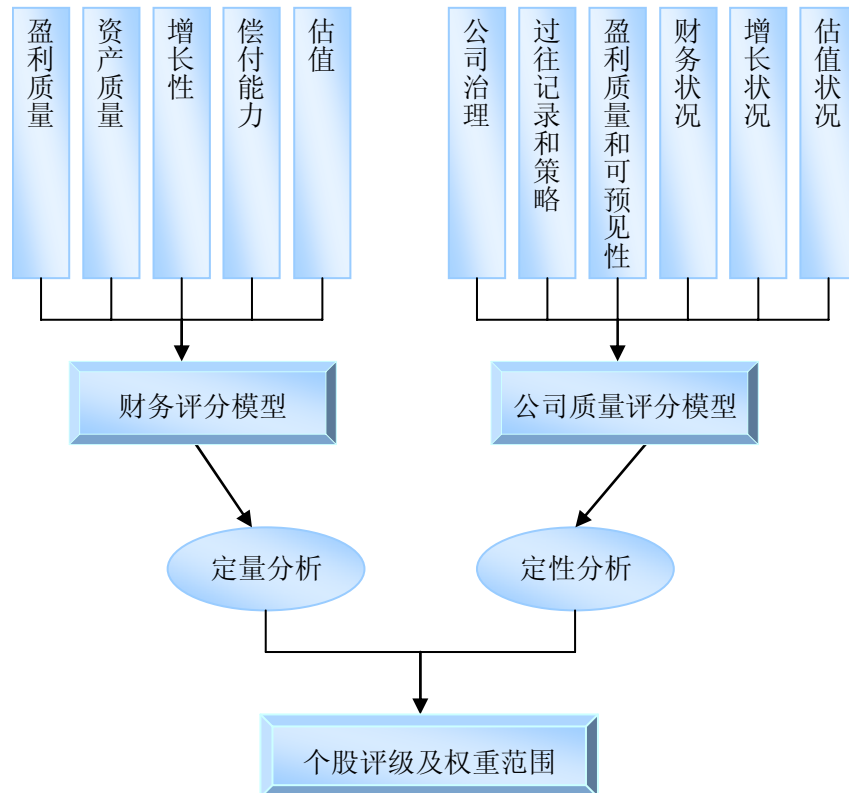
行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行

业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。



### 3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。



#### 4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

#### 5. 权证的投资

##### (1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并

根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。

C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。

D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。

E. 同时，本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。

F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析，基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断，主动投资于价值被市场低估的权证品种。

## (2) 权证的投资决策流程

### A. 权证的投资研究过程

研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析，并将结果通过定量化模型，对股票进行估值；数量分析小组负责构建和维护权证定价模型，在股票估值的基础上，对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上，结合基金的实际情况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统，对权证的风险进行测算，在各种可能的情景下，对权证进行估价，从而确定权证的投资风险，为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。

### B. 权证的投资决策过程

#### a. 权证投资方案的制定

投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上，结合基金的实际情况确定投资方案。

#### b. 权证投资的授权和审批

凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，可由基金经理自主执行，并向投资总监备案。

凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后，由基金经理在授权的范围内实施。

### c. 投资计划调整

投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。

## （五）业绩比较基准

$90\% \times \text{富时中国 A200 指数} + 10\% \times \text{同业存款利率}$

如果今后证券市场中出现其它代表性更强，更适合投资的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准应经投资决策委员会批准后报中国证监会核准，基金管理人在核准后 2 日内至少在一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

## （六）风险收益特征

本基金风险收益特征属于证券投资基金中风险程度中等偏高的品种，按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。本基金通过光大保德信特有的风险管理及绩效评估体系 EPPIC（Everbright Pramerica Portfolio Insight Computation）对投资风险进行全程嵌入式风险管理，通过风险预算管理及实时监控对投资风险进行事前监测，事中监控，事后监察，将风险水平控制在既定目标之内，并使风险尽量集中分布在置信度高的区域。

## （七）投资决策

### 1. 投资依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- 符合基金份额持有人利益最大化的原则
- 国家有关法律法规，基金合同及公司章程的有关规定
- 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；

- 国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；
- 各行业、地区发展状况；
- 上市公司财务状况、行业环境、市场需求状况及其当前市场价格；
- 证券市场资金供求状况及未来走势。

## 2. 投资管理程序

本基金强调团队式的投资管理机制，是国际成熟投资理念及本土长期投资经验的有效组合。在强调团队式管理机制的同时，各层次的投资决策主体各司其职，明确权限设置及分工，对投资决策过程进行严格的风险管理。

(1) 投资决策委员会是公司负责宏观投资决策和投资监督的机构，确定投资原则和投资范围；制定投资决策流程及权限设置；决定对基金经理的投资授权并审核批准超出基金经理投资权限的投资项目；定期对投资流程及投资决定进行审查。投资决策委员会由总经理、副总经理、投资总监、基金经理、研究主管和主要研究人员等人员组成。投资决策委员会的主任委员由总经理担任，一般每季度召开例会，如发生重大事宜，投资决策委员会召开临时会议作出相应决策；

(2) 投资总监负责投资组合委员会的日常管理，投资组合委员会每周召开例会，决定资产配置和投资组合构建的具体方案，对日常投资流程和投资决策进行审查；评估投资流程中的各个因素以便进一步优化整个流程，及时适应市场环境的变化。投资组合委员会由首席投资总监、投资总监、基金经理以及其他相关研究人员组成；

(3) 数量分析员着重关注量化研究，关注证券估值及预期收益率预测，每日将股票基本数据导入多因素数量模型，由数量模型预估股票预期收益率，作为投资组合构建的重要依据；

(4) 基金经理主要负责投资组合的日常管理，使投资组合的风险收益特征符合既定目标。基金经理着重关注行业景气状况及未来变动趋势，对行业进行评级，为投资组合优化提供行业选择的投资建议。此外，基金经理还负责研究新股及股票增发策略，并作出相应的投资决策；

(5) 研究员着重评估数据质量及可靠度，通过走访公司，对上市公司商业运营模式，公司治理情况，盈利状况及成长性，管理者能力和诚信度等基本面因素进行综合评估，并结合定量分析与定性分析对上市公司进行评级，为投资组合优化提

供个股选择的建议；

(6) 数量分析员将多因素数量模型估算的股票预期收益率及投资团队设置的投资组合优化参数导入投资组合优化器，产生经优化的投资组合备选方案，报投资组合委员会审议批准；

(7) 投资组合方案经投资总监负责的投资组合委员会批准后，由基金经理制定具体的建仓平仓计划，并决定买卖时机，以投资指令的形式下达至集中交易室。基金经理还应依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险；

(8) 集中交易室依据投资指令制定交易策略，统一执行投资交易计划，进行具体交易，并将指令的执行情况反馈给基金经理。投资组合决定权必须与交易下单权严格分离；

(9) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向风险控制委员会，投资决策委员会及投资组合委员会提出总结报告；

(10) 数量小组定期和不定期对基金进行投资绩效分析及风险评估，并提供相关报告，帮助投资团队和风险控制委员会及时了解基金收益主要来源及投资策略实施效果，投资组合风险水平及风险来源，从而及时调整投资组合，使其风险收益水平符合既定目标。

基金管理人有权在确保基金份额持有人利益的前提下根据实际情况对上述投资程序进行调整。

## (八) 投资限制

1. 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
2. 本基金持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券发行总量的 10%；
3. 本基金与本基金管理公司管理的其它基金持有一家上市公司发行的证券总量不得超过该证券的 10%；
4. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 5%。
5. 本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%。
6. 公司管理的全部基金持有的同一权证不超过该权证的 10%。



7. 中国证监会规定的其它比例限制。

本基金在基金合同生效后六个月内应达到上述比例限制。因基金规模变动，市场剧烈变化或其它不可抗力因素导致投资组合不符合上述规定比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内尽快进行调整，以使投资组合符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

### **(九) 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. 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. 将基金资产用于非法抵押、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利害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. 进行证券承销；
12. 通过关联交易、利益输送等损害基金份额持有人的利益；
13. 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止从事的其他行为。

### **(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则**

基金管理人接受基金份额持有人的委托，履行法律、法规、中国证监会及基金合同规定的义务，按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，恪尽职守、合法合规行使股东权利，充分维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：

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. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益；
3. 有利于基金资产的安全和增值；
4. 独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
5. 基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使股东权利。

### (十一) 基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 6 月 30 日。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,219,829,331.80	93.03
	其中：股票	10,219,829,331.80	93.03
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	742,361,387.79	6.76
6	其他各项资产	23,330,697.19	0.21
7	合计	10,985,521,416.78	100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	21,222,389.25	0.19
B	采掘业	984,287,122.46	8.98

C	制造业	2,719,063,494.03	24.81
C0	食品、饮料	420,769,326.90	3.84
C1	纺织、服装、皮毛	47,715,873.50	0.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	50,149,333.42	0.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	732,484,546.76	6.68
C5	电子	62,742,008.36	0.57
C6	金属、非金属	562,683,823.38	5.13
C7	机械、设备、仪表	727,234,443.66	6.64
C8	医药、生物制品	115,284,138.05	1.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	68,495,341.54	0.62
E	建筑业	21,412,903.30	0.20
F	交通运输、仓储业	990,150,711.42	9.03
G	信息技术业	460,763,915.40	4.20
H	批发和零售贸易	565,303,039.16	5.16
I	金融、保险业	3,517,888,661.99	32.10
J	房地产业	500,710,624.76	4.57
K	社会服务业	241,943,443.40	2.21
L	传播与文化产业	58,634,744.74	0.53
M	综合类	69,952,940.35	0.64
	合计	10,219,829,331.80	93.24

### 3. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	------	-----------

					(%)
1	000937	冀中能源	24,605,455	623,748,284.25	5.69
2	601601	中国太保	23,722,221	531,140,528.19	4.85
3	600016	民生银行	87,482,600	501,275,298.00	4.57
4	600029	南方航空	58,693,555	460,157,471.20	4.20
5	601318	中国平安	8,434,772	407,146,444.44	3.71
6	000001	深发展 A	22,706,014	387,591,658.98	3.54
7	600000	浦发银行	35,124,697	345,627,018.48	3.15
8	600036	招商银行	22,177,054	288,745,243.08	2.63
9	000792	盐湖股份	4,695,383	277,027,597.00	2.53
10	600009	上海机场	19,922,344	255,006,003.20	2.33

#### 4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（元）	占基金资产净值的比例
国家债券投资	-	-
央行票据投资	-	-
金融债券投资	-	-
企业债券投资	-	-
可转债投资	-	-
债券投资合计	-	-

#### 5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	名称	市值（元）	占基金资产净值的比例
1	-	-	-
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

#### 6. 投资组合报告附注

(1) 2009年9月9日五粮液公告了证监会调查通知书的有关内容。本基金投资

该股票的决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。报告期内本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

(2) 本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) 其他资产的构成如下：

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,112,397.34
2	应收证券清算款	7,977,864.79
3	应收股利	11,440,893.18
4	应收利息	134,242.59
5	应收申购款	665,299.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,330,697.19

(4) 报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末，报告期内本基金均无权证投资。

(6) 报告期内本基金未投资资产支持证券。

(7) 报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券（因认购新发证券而持有的流通受限证券）未违反相关法规或本基金管理公司的规定；

**7. 开放式基金份额变动（数据选取 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）**

本报告期期初基金份额总额	12,775,400,207.13
本报告期基金总申购份额	514,118,404.80
减：本报告期基金总赎回份额	1,090,778,827.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,198,739,784.62

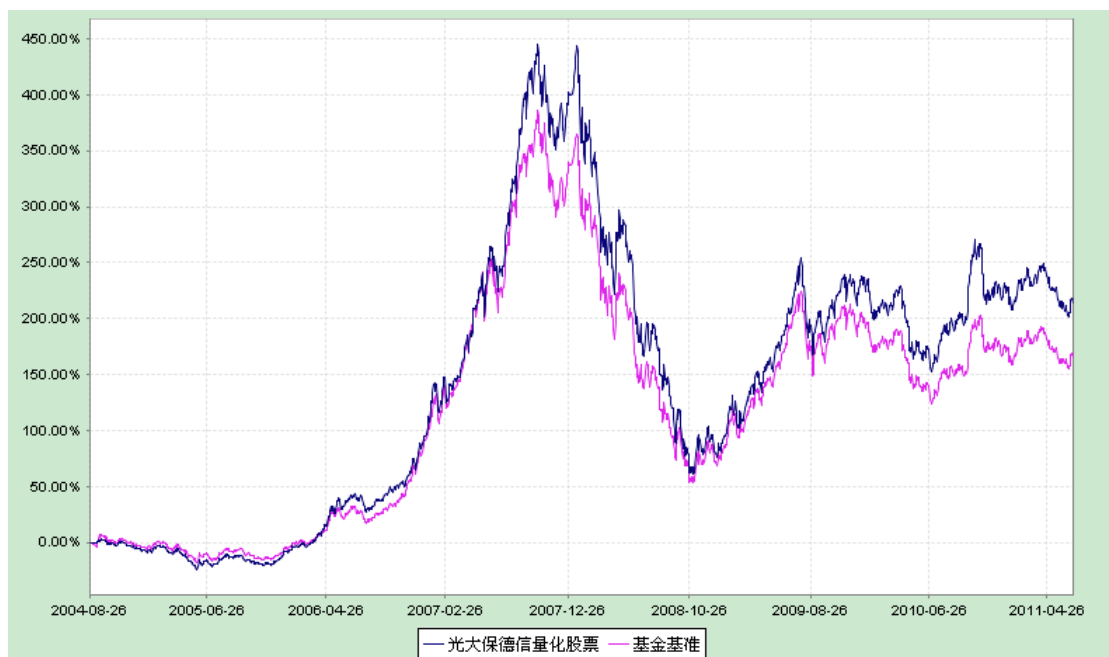
## 十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至 2011 年 6 月 30 日。

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
合同生效日(8月27日) — 2004年12月31日	-5.43%	0.68%	-3.13%	1.05%	-2.30%	-0.37%
2005年	-7.36%	1.15%	-7.11%	1.12%	-0.25%	0.03%
2006年	122.98%	1.32%	111.41%	1.24%	11.57%	0.08%
2007年	155.61%	2.13%	127.74%	2.06%	27.87%	0.07%
2008年	-64.75%	2.95%	-61.28%	2.71%	-3.47%	0.24%
2009年	90.61%	1.93%	80.20%	1.84%	10.41%	0.09%
2010年	-3.20%	1.59%	-10.67%	1.40%	7.47%	0.19%
自基金合同生效起至今	218.05%	1.87%	169.14%	1.76%	48.91%	0.11%

### (二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据本基金基金合同，本基金资产配置比例为股票 90%、现金 10%，由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化，股票持有比例允许在一定范围（上下 5%）内浮动。在本基金合同和相关法律法规规定的期限内，本基金资产配置达到上述比例要求。在本报告期内，本基金资产配置比例符合上述要求。

### **十三、基金的财产**

#### **（一）基金资产总值**

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

#### **（二）基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

#### **（三）基金财产的账户**

本基金以托管人和基金联名的方式开设证券账户，以基金托管人名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户。本基金的专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构自有的资产账户以及其它基金资产账户相互独立。

#### **（四）基金财产的保管及处分**

本基金财产独立于基金管理人、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。除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十四、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

基金合同生效后每个工作日对基金资产进行估值。

### (三) 估值方法

#### 1、股票估值方法

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，使潜在影响证券价格的所有投资品种的估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值；对于长期停牌的股票估值方法，采用指数收益法对长期停牌的股票进行估值，即在估值日，以该股票所上市的交易所行业分类指数中对应的行业指数的日收益率作为该股票的收益率，根据上述所得的收益率计算该股票当日的公允价值。上证行业分类指数由上海证券交易所提供，行情由上海证券交易所发布。深证行业分类指数由深圳证券交易所提供，行情由深圳证券交易所发布。

#### (2) 未上市股票的估值

1) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值



日证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值:

①估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票  
的初始取得成本时,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该  
非公开发行股票的价值;

②估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票  
的初始取得成本时应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值:

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

(3) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

## 2、权证估值方法

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

(2) 首次发行未上市的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难  
以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3) 停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证,以配股除权日起到配股确认日止,若  
收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值,若收盘价低于配股价,  
则估值为零。

(5) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

## 3、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 4、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

### (四) 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、权证、资产支持证券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产进行估值。

### (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) 估值错误的处理

基金份额净值的计算采用四舍五入方法保留到小数点后第四位。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四位以内（含第四位）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，基金管理人应当根据法律法规及相关规定的要求立即公告、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. 基金管理人在赔偿投资者或基金的损失后，有权向有关责任方追偿不当得利。

#### **(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. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

#### **(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股票估值方法的第(4)项和权证估值方法的第(3)项估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
3. 由于证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司发送的数据错误，或由于

其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## **十五、基金的收益分配**

### **(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. 已实现的其他合法收入。

基金资产运作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入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) 基金收益分配原则**

1. 基金收益分配的比例按有关规定制定；
2. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；
3. 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，但若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
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. 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。
8. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

9. 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**

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金收益的分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

#### **(五) 基金收益分配方案的确定与公告**

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在 2 日内公告并报中国证监会备案。

#### **(六) 收益分配中发生的费用**

1. 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者一定的比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或招募说明书更新中规定。
2. 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

### **十六、基金的费用与税收**

#### **(一) 与基金运作有关的费用**

##### **1. 基金管理人的管理费**

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

每日应付的基金管理费=前一日的基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，无须召开基金份额持有人大会通过。如降低基金管理费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前 2 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

##### **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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

每日应付的基金托管费=前一日的基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金托管费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前 2 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1. 申购费

本基金的申购费由申购人承担，不记入基金资产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。本基金申购费率设置如下表所示：

申购金额（含申购费）	申购费率
1000 万元以下	1.5%（采取网上交易方式申购费率为 0.6%）
1000 万元以上（含 1000 万元）	每笔交易 1000 元人民币

### 2. 赎回费

赎回费由赎回人承担，赎回费在扣除手续费及注册登记费后，余额部分全部归入基金资产，归入基金资产的赎回费比例不得低于赎回费总额的 25%。本基金赎回费率设置如下表所示：

持有期	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年至 2 年（含 1 年）	0.2%
2 年及以上	0%

注：赎回费的计算中 1 年指 365 个公历日。

### 3. 转换费

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转

换费用由基金持有人承担。具体公式如下：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金单位资产净值

转换费用：

如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率，

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率 + 转出金额 × 转出基金与转入基金的申购费率差

如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率，

转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

转入金额 = 转出金额 - 转换费用

转入份额 = 转入金额 ÷ 转入基金当日基金单位资产净值

4. 经报中国证监会批准，基金管理人可以在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2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。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。

### （三）其他费用

其他费用包括证券交易费用；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；按照国家有关规定可以列入的其他费用。上述费用由基金托管人根据其他有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期基金费用，由基金托管人从基金资产中支付。

基金合同生效前的会计师费、律师费、信息披露费用，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。

### （二）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计事务所不能同时从事本基金的审计业务；
2. 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度报告义务，如果基金合同生效至12月31日之间少于3个月，可以并入下一个会计年度；
3. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关会计制度；
5. 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。
7. 本基金独立建账、独立核算；
8. 上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，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) 基金审计**

1. 本基金管理人聘请安永华明会计师事务所有限责任公司及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。安永华明会计师事务所有限责任公司及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券审计业务的资格。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人的同意，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）同意后2日内公告并报中国证监会备案。

## **十八、 基金的信息披露**

### **(一) 信息披露的形式**

本基金的信息披露严格按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定进行。基金管理人将按照有关法律、法规的规定将应披露的基金信息通过至少一种指定媒体予以公告并同时在本基金管理人的网站 [www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn) 披



露。

## **(二) 信息披露的内容及时间**

### **1. 基金发售信息披露**

(1) 招募说明书：基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前在至少一种指定媒体上公告并同时基金管理人的网站登载。

(2) 基金合同及摘要：基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前在至少一种指定媒体上公告；同时基金管理人、基金托管人应在其网站登载基金合同全文。

(3) 基金托管协议：在公告招募说明书和基金合同摘要的同时，基金管理人、基金托管人应将基金托管协议登载在其网站上。

(4) 基金份额发售公告：基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》及相关法律法规的规定编制基金份额发售公告并在披露招募说明书当日刊登在至少一种指定媒体和基金管理人网站。

(5) 基金合同生效公告：基金管理人于基金合同生效次日在至少一种指定媒体和基金管理人网站登载。

基金管理人应在开放式基金的基金合同、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。

### **2. 定期报告**

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照《基金法》、《信息披露办法》及其他一系列有关证券投资基金信息披露的法规编制，包括年度报告、半年度报告、季度报告及更新的招募说明书，并在至少一种指定媒体和基金管理人网站登载。

基金管理人在定期报告公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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。

定期报告及其公布方式为：

(1) 年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

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

(4) 更新的招募说明书：本基金的基金合同生效后，基金管理人应在每 6 个月结束之日起 45 日内更新招募说明书并登载在基金管理人的网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。更新内容截止至每 6 个月的最后一日。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

### 3. 基金临时信息披露

本基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益或者基金份额的收益产生重大影响的事项之一时，基金管理人应当在 2 日之内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

- (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%（不含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%（不含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到法律法规及相关规定的限制；
- (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。

#### 4. 澄清公告

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额净收益产生误导性影响或引起较大波动时，相关的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及基金上市交易的证券交易所。

#### (三) 信息披露文件的存放与查阅

1. 基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息管理工作。
2. 基金的招募说明书公告后，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。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。

3. 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，供公众查阅、复制。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。

## 十九、风险揭示

### (一) 投资于本基金的风险

#### 1. 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而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影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生潜在风险。主要包括：

##### (1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区发展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

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益产生影响。

##### (3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时也影响到上市公司的融资成本和利润水平，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。从而影响基金投资收益。

##### (5) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2. 信用风险

指基金在交易过程中可能发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

### **3. 管理风险**

在基金管理运作过程中，基金管理人的投资管理水平，会影响其对信息的占有分析以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；同时，基金管理人的投资管理制度，风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其它合规性风险，以及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。

### **4. 流动性风险**

开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资产净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响基金份额净值。

### **5. 基金产品的风险**

(1) 本基金是一只积极投资的股票基金，主要通过数量模型选择股票并构建投资组合，由于上市公司财务数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，可能导致数量模型对股票收益率的预期产生偏差，从而给本基金的股票选择带来风险。

(2) 由于本基金资产配置比例相对固定，且股票资产比例较高，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

### **6. 其他风险**

(1) 因技术系统故障或差错等因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险，这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记人、销售机构等；

(2) 因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

(3) 战争，自然灾害等不可抗力可能导致基金资产损失，从而产生风险；

(4) 其他意外导致的风险。

## **(二) 声明**

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

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

## 二十、 基金的终止与清算

### (一) 基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

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 个工作日低于人民币 5000 万元，基金管理人依照法律法规及基金合同规定的程序宣布该基金终止；
2. 基金经基金份额持有人大会表决终止的；
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、丧失基金管理资格等事由，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接其原有权利及义务；
5. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
6. 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接其原有权利及义务；
7. 法律、法规和中国证监会规定的其他终止事由。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

### (二) 基金的清算

#### 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。在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人

以及上述会计师事务所和律师事务所应在基金终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。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) 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) 以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- (8) 发布基金清算结果公告；
- (9) 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. 基金清算剩余资产的分配**

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**

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告由基金财产清算小组报中国证监会备案后 2 日内公告。

## **6. 基金清算帐册及文件的保存**

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1. 基金份额持有人的权利和义务

##### (1) 基金份额持有人的权利

- A. 分享基金财产收益；
- B. 按照规定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；
- C. 监督基金经营情况；
- D. 获得基金业务及财务状况的资料；
- E. 因基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构或基金注册登记人的过错导致基金份额持有人损失时，基金份额持有人对此具有求偿权，可对损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- F. 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- G. 参与分配清算后的剩余基金财产；
- H. 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其他基金份额持有人利益的活动；
- E. 法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### 2. 基金管理人的权利和义务

##### (1) 基金管理人的权利

- A. 自本基金合同生效之日起，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. 遵照有关法律法规和基金合同的规定，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的费率结构和收费方式；
- C. 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；
- D. 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；

E. 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；

F. 根据基金合同的规定提议召开基金份额持有人大会；

G. 选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督。如认为基金代销机构违反基金合同、《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份额持有人的利益；

H. 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；

I. 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；

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. 基金合同终止时，参加基金财产清算小组，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. 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作基金资产；

B. 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、交易、销售和监察稽核，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；

C. 依法募集基金，设置相应的部门并配备足够的专业人员办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的认购、申购、赎回事宜；

D. 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其他机构代理该项业务；

- E. 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自有资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- F. 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；
- G. 接受基金托管人依据法律法规、基金合同和托管协议进行的监督；
- H. 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额资产净值；
- I. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告、中期和年度基金报告，并严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行其他信息披露及报告义务；
- J. 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；
- K. 依据有关法律、法规及基金合同决定基金收益分配方案，并按规定及时向基金份额持有人分配基金收益；
- L. 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、分红款项；
- M. 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- N. 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，执行基金份额持有人大会的决议；
- O. 保存基金的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- P. 确保需要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基金合同规定的时间和方式，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；
- Q. 参加基金财产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- R. 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；
- S. 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；因估值错误导致基金份额持有人的损失，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；

T. 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；

U. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

V. 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；

W. 办理基金备案手续；

X. 遵守基金合同；

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、法规和本基金合同的规定持有并保管基金资产，监督本基金的投资运作；

B. 依据本基金合同约定获得基金托管费、其它法定收入和其它法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

C. 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了本基金合同及国家有关法律法规，应及时呈报中国证监会，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、本基金合同及托管协议另有规定，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. 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

F. 法律、法规和本基金合同规定的其他权利。

#### **(2) 基金托管人的义务**

A. 依法持有基金资产；

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财产相互独立；对所托管的不同基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

E. 除《基金法》等有关法律法规及本基金合同及其他有关规定另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；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，造成基金资产损失的，承担赔偿责任；

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. 根据有关规定以托管人和基金联名的方式为基金开设证券帐户，以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，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，负责基金名下的资金往来；

H. 保守基金商业秘密，除《基金法》等有关法律法规及本基金合同另有规定外，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资产净值；

J. 采取适当、合理的措施，使本基金份额的认购、申购、赎回等事项符合法律、法规和本基金合同等有关法律文件的规定；

K. 采取适当、合理的措施，使本基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合法律、法规和本基金合同等有关法律文件的规定；

L. 按照规定监督基金管理人的投资运作，并采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律、法规、本基金合同或其他有关法律文件的规定；

M. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项，按规定出具基金业绩和基金托管情况报告，并呈报中国证监会和中国银监会；

N. 在基金财务会计报告、中期和年度基金报告等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本基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行本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；

O. 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

P. 按有关规定，保存基金托管业务活动的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

Q. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

R. 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；

S. 参加基金财产清算小组，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,应及时报告中国证监会和中国银监会,并通知基金管理人;

U. 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;

V. 监督基金管理人按本基金合同的规定履行自己的义务,因基金管理人过错造成基金资产损失时,应为基金向基金管理人追偿,除法律法规和本基金合同规定之处,基金托管人不对基金管理人承担连带责任;

W. 按照规定召集基金份额持有人大会;

X. 不得从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动;

Y. 遵守本基金合同;

Z. 法律、法规和本基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

有以下情形之一的,应召开基金份额持有人大会:

- (1) 终止基金合同;
- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 与其他基金合并;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (8) 变更基金份额持有人大会程序;
- (9) 法律、法规、和中国证监会规定的其他情形。

### 2. 召集方式

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

面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%，该比例以提出提议之日提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）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，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。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。

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) 基金份额持有人大会的会议时间、地点及权益登记日由召集人选择确定。

### 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、收取方式和截止时间。

#### 4. 会议的召开方式

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。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:

- A. 亲自出席会议者应持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具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应符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定;
- B. 参加会议的基金份额持有人或其授权代表所代表的基金份额超过权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。

##### (2) 通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

- A. 召集人已经按基金合同的规定公告了会议通知;
- B. 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;
- C. 召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人(包括其授权代表)所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%)。

D. 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代理投票授权委托书应符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定；

E. 会议通知公布前已报中国证监会备案。

(3) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

## 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，如决定终止基金、转换基金运作方式、提高基金管理人或基金托管人报酬标准、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、变更基金类别、变更基金投资目标、范围或策略、变更基金份额持有人大会程序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

#### A. 现场开会

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（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。

#### B. 通讯方式开会

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，亲自参加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代理投票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:

A. 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 50% 以上(含 50%) 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。

B. 特别决议。特别决议须经参加会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、终止基金合同等重大事项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表决。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

A. 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。基金份额持有人大会主持人为召集人出席大会代表。

B. 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。

C. 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。

D. 计票过程应由公证机关予以公证。

## **(2) 通讯方式开会**

在通讯方式开会的条件下，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（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## **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。

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

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内由相关信息披露义务人按照本基金合同的规定进行公告。

## **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**

### **1. 基金的终止**

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

(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 个工作日低于人民币 5000 万元，基金管理人依照法律法规及基金合同规定的程序宣布该基金终止；

(2) 基金经基金份额持有人大会表决终止的；

(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、丧失基金管理资格等事由，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接其原有权利及义务；

(5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

(6) 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接其原有权利及义务；

(7) 法律、法规和中国证监会规定的其他终止事由。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

## 2. 本基金合同的终止

基金终止后，应依据法律、法规和本基金合同的规定对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起，本基金合同终止。

### (四) 争议的处理

本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，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，可向中国国际贸易仲裁委员会上海分会，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) 基金合同存放地点和查询办法

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。

## 二十二、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：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层

法定代表人：林昌

成立日期：2004 年 4 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42 号

注册资本：人民币 1.6 亿元

电话：(021) 33074700

传真：(021) 63351152

客服电话：400-820-2888；(021) 53524620

联系人：张弛

网址：www.epf.com.cn

## 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

法定代表人：唐双宁

成立日期：1992 年 8 月 18 日

注册资本：282.1689 亿元人民币

电话：(010) 68560675

传真：(010) 68560661

客服电话：95595

联系人：石立平

网址：www.cebbank.com

### (二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1. 根据《基金法》、基金合同和有关法律、法规的规定，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《基金法》、基金合同和有关法律、法规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《基金法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(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《基金法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否将基金资产和自有资产分账管理、是否擅自自动用基金资产、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《基金法》、基金合同和有关法律、法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。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) 基金资产保管**

#### **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《基金法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。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《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金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；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的帐簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，保证

不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立。

(7) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

(8) 未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## **2. 基金合同生效时募集资金的验证**

基金设立募集期满或本基金的基金管理人宣布停止募集时，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。

如果基金合同不能生效，按《基金法》及基金合同的规定处理。

## **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、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4) 基金银行账户的管理应符合中国人民银行、中国银监会以及其他监管机构的有关规定。

## **4. 基金证券账户和资金账户的开设和管理**

(1) 基金托管人应当代表基金以托管人和本基金的名义为本基金在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司开立证券帐户。

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

(3) 基金托管人应当按规定在中国证券登记结算有限责任公司开立清算备付金账户，并通过该帐户完成本基金的证券交易和资金清算。

(4) 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。

#### **5. 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。

#### **6. 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。

#### **7. 国债托管专户的开设和管理**

(1) 基金合同生效后，基金管理人负责代表基金向中国证监会和中国银监会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，并代表基金进行银行间债券和回购交易的资金清算。

(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。

8. 因为登记结算模式转换，关于账户开设、超头寸交易等处理，需要双方共同签署《补充托管协议》或《资金结算协议》，待新文本确定后，双方补充签署。

《补充托管协议》或《资金结算协议》中如有与本协议相关条款冲突或不一致的内容，以《补充托管协议》或《资金结算协议》为准。如国家法规或监管机构有新的规定，以新的规定为准。

如监管机构有新的规定，以监管机构的规定为准，参照执行。

### **(四) 资产净值计算和会计核算**

#### **1. 基金资产净值的计算和复核**



(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总份额后的价值。

(2) 基金管理人应于每个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；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。

## **2. 基金账册的建账和对账**

(1) 基金管理人和基金托管人在本基金合同生效后，应按照财政部《证券投资基金会计核算办法》规定的同一记账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账册，对双方各自的账册定期进行核对，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，原则上以基金管理人的处理方法为准。

(2) 双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

## **3. 基金财务报表与报告的编制和复核**

(1) 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 日内完成；季度报告在本基金合同生效后每季度公告一次，每季终了后 10 个工作日内完成，15 个工作日内公告；更新的招募说明书在本基金合同生效后每六个月公告一次，于基金合同生效后每 6 个月结束之日起 45 日内公告。半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告（基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告和年度报告）。

(2) 基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供基金托管人复核；基金托管人在收到后应及时进行复核，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，基金托管人应在

收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式进行。

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

#### **(五) 基金份额持有人名册的保管**

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，由基金管理人和基金托管人分别负责保管。

#### **(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北京分会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。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) 托管协议的修改和终止**

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) 本基金更换基金托管人；
- (3) 本基金更换基金管理人；

发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。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. 资料寄送

#### (1) 基金投资人对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单每季度提供，在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单在每年度结束后 20 个工作日内对所有基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送。

#### (2) 其他相关的信息资料

### 2. 红利再投资

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

### 3. 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销网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。

### 4. 在线服务

基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理（或投资顾问）的定期或不定期在线交流服务，在技术条件成熟时，基金管理人还可提供网上交易和电话交易服务。

## 5. 资讯服务

(1) 投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打光大保德信基金管理有限公司客服电话：

客服电话：400-820-2888；（021）53524620，该电话可转人工座席。

传真：（021）63352654

## (2) 互联网站

公司网址： www.epf.com.cn

电子信箱： epfservice@epf.com.cn

## 6. 投诉处理服务

光大保德信客户服务中心提供人工投诉、语音留言投诉、信件和电子邮件投诉等多种投诉渠道。客户投诉分级管理、限期处理。客户服务中心负责跟踪投诉处理的全过程，并将处理结果答复客户。

## 二十四、其他应披露事项

(一) 2011年2月27日至2011年8月26日未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(二) 2011年2月27日至2011年8月26日基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

(三) 2011年2月27日至2011年8月26日相关公告事宜列示如下，下列公告刊登在上海证券报、中国证券报、证券时报及光大保德信基金管理有限公司网站上。

披露时间	公告内容
2011年3月5日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金参与光大证券股份有限公司网上交易系统定期定额申购费率优惠活动的公告
2011年3月22日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金所持“双汇发展”停牌股票估值调整的公告
2011年3月26日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金所持“双汇发展”停牌股票估值调整的公告

2011年3月29日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增东莞农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告
2011年3月30日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告
2011年4月9日	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）摘要
2011年4月12日	光大保德信基金管理有限公司关于在中信证券股份有限公司新增旗下部分基金代销业务及开办基金定期定额申购业务和基金转换业务的公告
2011年4月15日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江稠州农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告
2011年4月18日	光大保德信基金管理有限公司关于公司股权变更的公告
2011年4月22日	光大保德信量化核心证券投资基金 2011 年第 1 季度报告
2011年4月26日	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告
2011年5月4日	光大保德信基金管理有限公司高管人员离任公告
2011年6月11日	光大保德信基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告
2011年6月23日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金通过网上直销进行基金转换业务的转换费率优惠的公告
2011年6月29日	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司个人网银、移动银行申购开放式基金费率优惠的公告
2011年7月2日	光大保德信基金管理有限公司关于使用招商银行“一卡通”通过网上直销办理基金转换业务的费率优惠公告
2011年7月19日	光大保德信量化核心证券投资基金 2011 年第 2 季度报告
2011年8月3日	光大保德信基金管理有限公司广州分公司成立公告

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销

机构的办公场所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件。

## 二十六、备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件
- (二) 基金合同
- (三) 销售代理协议
- (四) 托管协议
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (八) 代销机构业务资格批件、营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件