

# 东方稳健回报债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）

### （2009年第2号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

日期：二〇一〇年一月

## 重要提示

东方稳健回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2008年10月15日中国证券监督管理委员会《关于核准东方稳健回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】1188号）和《关于东方稳健回报债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2008】473号）的核准，进行募集。本基金基金合同于2008年12月10日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方稳健回报债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

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。

有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为2009年12月10日。

## 目 录

一、绪 言 .....	1
二、释 义 .....	1
三、基金管理人.....	5
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	19
六、基金的募集与基金合同的生效.....	30
七、基金份额的申购与赎回.....	30
八、基金的投资.....	38
九、基金的业绩.....	50
十、基金的财产.....	51
十一、基金资产的估值.....	52
十二、基金的收益与分配.....	56
十三、基金的费用与税收.....	57
十四、基金的会计与审计.....	59
十五、基金的信息披露.....	60
十六、风险揭示.....	63
十七、基金的终止与清算.....	65
十八、基金合同的内容摘要.....	68
十九、基金托管协议的内容摘要.....	81
二十、对基金份额持有人的服务.....	90
二十一、其他应披露事项.....	92
二十二、招募说明书存放及查阅方式.....	93
二十三、备查文件.....	93

## 一、绪 言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定以及《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本《招募说明书》阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明的资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权其他任何人对未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本《招募说明书》根据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。基金投资者取得依基金合同所发售的基金份额，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；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金合同。

## 二、释 义

在《本基金招募说明书》中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

1. 基金或本基金：指东方稳健回报债券型证券投资基金
2. 基金管理人：指东方基金管理有限责任公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方稳健回报债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《东方稳健回报债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7. 基金份额发售公告：指《东方稳健回报债券型证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9. 《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
14. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
16. 个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
17. 机构投资者：指符合法律法规规定，可以投资开放式证券投资基金的、在中国注册登记或经政府有关部门批准设立的法人、社会团体和其他组织、机构
18. 合格境外机构投资者：指符合法律法规规定的、可投资于中国境内证券市场的中国境外机构投资者
19. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
20. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
21. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
22. 销售机构：指直销机构和代销机构
23. 直销机构：指东方基金管理有限责任公司
24. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务

资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

26. 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账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

27. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为东方基金管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理注册登记业务的机构

28. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

30. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31. 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，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32. 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，最长不得超过3个月

33. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

36. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

37. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39. 《业务规则》：指《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则

40. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

41. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额

兑换为现金的行为

43. 销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

44. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

45. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

46. 非交易过户：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投资者账户转移到其他账户的行为

47. 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

48. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

49. 元：指人民币元

50. 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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

51. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

52. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54. 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

55. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

56. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政

府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

法定代表人：李维雄

总经理：单宇

成立日期：2004年6月11日

注册资本：壹亿元人民币

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：1100001704226

联系人：吕日

电话：010-66295888

#### 股权结构

持股单位	出资金额（人民币）	占总股本比例
东北证券股份有限公司	4600 万元	46%
中辉国华实业（集团）有限公司	1800 万元	18%
上海城投控股股份有限公司	1800 万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800 万元	18%
合计	10000 万元	100%

#### 内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。董事会下设合规与风险控制委员会；本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会和研究部、基金管理部、交易部、市场部、专户管理部、信息技



术部、登记清算部、金融工程部、监察稽核部、人力资源部、综合管理部、财务部十二个职能部门；本公司设督察长，领导监察稽核部，负责公司的监察稽核工作。

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1. 董事会成员

李维雄先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。1988年起先后在吉林省政府办公厅、吉林省信托投资公司、吉林省财政厅工作，1999年历任吉林证券重组领导小组组长，2000年起任东北证券有限责任公司董事长兼总裁，2001年6月起任东北证券有限责任公司总裁；自本公司成立以来担任董事长。

杨树财先生，董事，中国注册会计师，高级会计师。吉林省高级职称评委会委员，中国证券业协会财务会计委员会执行委员。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师，吉林会计师事务所副所长，东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监，现任东北证券股份有限公司总裁。

安红军先生，董事，经济学博士。历任南方证券投资银行总部上海业务处处长、南方证券上海分公司总经理助理、南方证券投资银行总部副总经理、总经理，天同证券总裁助理，华泰证券有限公司投资银行业务总监，上海世博土地控股有限责任公司业务总监，上海市原水股份有限公司总经理，上海城投控股股份有限公司总经理；现任上海城投控股股份有限公司总裁。

许建军先生，董事，经济学学士。历任中国建设银行新疆分行科员，建行乌市新市区办事处副主任，新疆房改办特派员，新疆建银租赁设备公司总经理，北京宏世通达商贸集团总裁。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任廊坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司党委书记、董事长。

单宇先生，董事，大学本科。15年以上证券及基金从业经历，历任吉林省信托投资公司证券管理总部证券投资管理部经理，吉林省宝路达投资管理公司总经理，天治基金管理有限公司筹备组成员、副总经理、监事长，东北证券有限责任公司副总裁，东北证券股份有限公司副总裁、合规总监；现任本公司总经理。

黑学彦先生，独立董事。大学本科，高级经济师。历任吉林省委财贸部基层工作处处

长，吉林省经委进出口处处长，吉林省商业厅副厅长，吉林省国际信托公司董事长、总经理兼党组书记，海南省国际信托投资公司董事长、总经理、党委书记，中国证券业协会副秘书长，银华基金管理有限公司董事长。

宋冬林先生，独立董事，经济学博士。现任长春税务学院院长，吉林大学经济学院经济学教授，博士生导师，享受国务院政府津贴。

刘锋先生，独立董事，金融学博士，教授。现任中国金融理财标准委员会副秘书长兼金融学教授，麦吉尔大学管理学院中国项目管理中心主任和金融财务学兼职教授，加中金融协会副会长，中国人民银行研究生部访问教授，中国人民大学商学院兼职教授，中央财经大学访问教授，大连理工大学客座教授，美国金融学会和加拿大管理科学学会会员。

## 2. 监事会成员

程红女士，监事长，会计学硕士，高级经济师。历任中国建设银行吉林省分行房贷部业务经理，吉林省信托投资公司长春解放大路营业部副总经理，东北证券有限责任公司北京总部总经理、总裁助理；自本公司成立以来，历任本公司副总经理、总经理；现任本公司监事长。

蒋家智先生，监事，硕士研究生，经济师。历任上海道勤企业咨询有限公司咨询顾问，上海水务资产经营发展有限公司资产经营部副经理，上海市原水股份有限公司资产经营部副经理，上海城投控股股份有限公司资产经营部副经理；现任上海城投控股股份有限公司投资管理部总经理。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，15年金融、证券从业经历；现任本公司监察稽核部经理。

## 3. 其他高级管理人员

单宇先生，总经理，简历请参见董事介绍。

付勇先生，副总经理。北京大学经济学博士，会计学硕士，数学学士。10余年金融、证券从业经历，曾先后在中国建设银行总行、华龙证券有限责任公司、东北证券有限责任公司工作；2004年加盟本公司，曾任发展规划部经理、投资总监助理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、总经理助理；现任本公司副总经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理。

吕日先生，督察长，吉林大学经济学院政治经济学专业博士研究生，高级经济师。曾担任吉林省证券公司长春北国之春营业部副经理、延吉证券营业部副经理、营业机构管理

部经理；东北证券股份有限公司总裁助理兼营销交易管理总部总经理。2008年11月加盟本公司，现任本公司督察长。

#### 4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
杨林耘（女士）	2008年12月10日至今	北京大学经济学院金融硕士。16年金融、证券从业经历。曾先后在武汉融利期货任首席交易员和高级分析师，在泰康人寿保险资产管理公司任高级项目经理，在中国对外经济贸易信托有限公司任融资业务部总经理助理、交易部总经理助理、证券业务部高级投资经理。2008年11月加盟本公司。
郑军恒（先生）	2008年12月10日至今	北京大学分子生物学硕士。10年金融、证券从业经历，曾任天津氨基酸公司助理工程师，先后在北京涌金财经顾问有限公司、博时基金管理有限公司、江南证券基金筹备组任分析师、研究员。2005加盟本公司，曾任研究部副经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理。2009年6月24日至今担任东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理。

#### 5. 投资决策委员会成员

付勇先生：公司副总经理，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员。

钱斌先生：专户管理部经理，投资决策委员会委员。经济学硕士，12年投资研究经验，

曾先后在上海申华实业股份有限公司、长盛基金管理有限公司、深圳今日投资管理有限公司和诺德基金管理有限公司工作。

李骥先生：研究部经理，投资决策委员会委员。北京大学博士研究生，8年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。

#### 6. 上述人员之间均不存在近亲属关系

##### （三）基金管理人职责

##### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 发售基金份额；

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

(6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

(8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

(9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 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

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

(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，分别记账，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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 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；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 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和有关机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 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：

(19) 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；

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

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

(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谋取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (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) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 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、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

##### 1. 内部控制制度

###### (1) 内部控制的原则

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：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

③独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，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营成本, 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) 内部控制的主要内容

### <1>控制环境

①控制环境构成公司内部控制的基础, 环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度, 组织内控设计并以身作则、积极执行, 牢固树立诚实信用和内控优先的思想, 自觉形成风险管理观念; 通过营造公司内控文化氛围, 增进员工风险防范意识, 使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查, 对公司建立有效的内部控制体系承担最终责任; 同时, 通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能, 避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生, 建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制, 包括民主透明的决策程序和管理议事规则, 高效严谨的业务执行系统, 以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度, 严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度, 确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

### <2>风险评估

内部稽核人员定期评估公司风险状况, 范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素, 评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性, 并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

### <3>组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次: 董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导;

公司董事会通过其下设的合规及内部控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。



合规及风险控制委员会在董事会领导下，对公司固有资产和基金资产运作的合法合规性进行全面、重点的跟踪分析并提出改进方案，调整、确定公司的内部控制制度并评估其有效性，其目的是完善董事会的合规监控功能，建立良性的公司治理结构。

督察长负责合规及风险控制委员会决议的具体执行，按照中国证监会的规定和合规及内部控制委员会的授权对公司和基金运作的合规合法性进行监督稽核。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和监察稽核部：

①总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构，并负责公司层面风险管理工作。

②风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准，划分和量化市场风险，并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

③监察稽核部是公司基金运作的监察稽核部门，负责对公司和基金运作的合法合规性及内部控制制度的建立和执行情况进行监察稽核，并使用数量化的风险管理系统，对基金投资过程中的市场风险进行独立监控，形成基金投资的绩效评价和风险控制评价。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各职能部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据公司经营计划、业务规划和各部门的具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，并严格执行，将风险控制在最小范围内。

#### <4>制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

①内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

②内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

③业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### <5>信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人

员进行处理。

## 2. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持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；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司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：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12 号

联系人：尹东

联系电话：010-67595003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

2009年上半年，中国建设银行实现净利润558.41亿元，同比下降4.86%，每股盈利为0.24元（半年），同比减少0.01元，盈利水平符合预期；年化平均资产回报率、年化平均股东权益回报率分别为1.34%和22.54%，较上年全年分别提高0.03和1.86个百分点，整体盈利趋势向好；总资产达到91,101.71亿元，较上年末增长20.58%；资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为1.71%，较上年末下降0.5个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为150.51%，较上年末提升18.93个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约设有分行，在伦敦设有全资子公司、在悉尼设有代表处。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）31,896台，居全球银行业首位。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，在2009年上半年共获得40多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌500强”、“全球银行1000强”中分列第9位和第12位，被《亚洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，被《欧洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”，荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”，中国扶贫基金会颁发的“20年特别贡献奖”等奖项，被中国红十字基金会评为“最具责任感企业”，连续两年荣获香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

## 2. 主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、

筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3. 基金托管业务经营情况

截止到 2009 年 9 月 30 日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等 7 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华一道琼斯 88 指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、华夏中小板 ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票（LOF）、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票（LOF）、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票（QDII）、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票（QDII）、海富通中国海外股票（QDII）、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信 2026 周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票（QDII）、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票（LOF）、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳

健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深 300 指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合、天治趋势精选灵活配置混合、中欧价值发现股票、长信恒利优势股票、民生加银增强收益债券、国联安主题驱动股票、宝盈货币市场基金、博时策略灵活配置混合、信诚优胜精选股票、易方达沪深 300 指数、中银中证 100 指数增强、鹏华精选成长股票、金元比联价值增长股票、诺德成长优势股票、摩根士丹利华鑫领先优势、华宝兴业中证 100 指数、华安上证 180ETF 联接基金、农银汇理策略价值股票基金等 125 只开放式证券投资基金。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3. 内部控制制度和措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （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

## 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2. 监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）直销机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

法定代表人：李维雄

联系人：王晓乐

电话：010-66295916

传真：010-66578700

网址：www.orient-fund.com

### （二）代销机构

1. 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：郭树清

联系人：何奕

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

2. 中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王隼

电话：010-66107900

传真：010-66108013

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

3. 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

联系人：靳晓洁

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

4. 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

联系人：万丽

电话：0755-83195475

传真：0755-83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

5. 中国民生银行股份有限公司

住所：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

联系人：董云巍

电话：010-58351666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

6. 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

电话：010-66599805

传真：010-66415194

客户服务电话：11185

网址：www.psbc.com

7. 北京银行股份有限公司

住所：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号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：王光伟



电话：010-66223236

客户服务电话：010-96169（北京）022-96269（天津）021-53599688（上海）

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

8. 中信银行股份有限公司

住所：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

联系人：宋晓明

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

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

9. 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

10. 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：潘凯

电话：0431-85096709

客户服务电话：0431-96688-0

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

11. 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：胡长生

联系人：李洋

电话：010-66568888

传真：010-66568536

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

#### 12. 中信证券股份有限公司

住所：深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

客户服务电话：各地营业部咨询电话

网址：www.ecitic.com

#### 13. 申银万国证券股份有限公司

住所：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：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

#### 14. 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：王立群

电话：021-23219286

传真：021-23219100

客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

15. 中信建投证券有限责任公司

住所：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

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

16. 山西证券有限责任公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：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

联系人：张治国

电话：0351-8686703

传真：0351-8686709

客户服务电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

17. 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号3楼

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

18. 中信金通证券有限责任公司

住所：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：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

联系人：王勤 徐蕾

电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：www.96598.com.cn

19. 国元证券股份有限公司

住所：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

联系人：祝丽萍

电话：0551-2207938

传真：0551-2207965

客户服务电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

20. 中信万通证券有限责任公司

住所：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：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

联系人：丁韶燕

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

21. 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务电话：021-962506 或 40088-88506

网址：www.dfzq.com.cn

22. 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

23. 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-68419393-1098

传真：021-68419867

客户服务电话：4008888123, 021-68419393-1098

网址：www.xyzq.com.cn

24. 安信证券股份有限公司

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

法定代表人：牛冠兴

联系人：吴跃辉

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.axzq.com.cn

25. 国信证券股份有限公司

住所：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

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

26. 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：021-63219781

传真：027-85481900

客户服务电话：4008-888-999 或 027-85808318

网址：www.cjsc.com

27. 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：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

联系人：黄健

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

#### 28. 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路128号

办公地址：山东省济南市千佛山路3号济南商业银行四楼

法定代表人：李玮

联系人：傅咏梅

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

#### 29. 江海证券经纪有限责任公司

住所：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

电话：0451-82336863

传真：0451-82269290

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

#### 30. 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085338

传真：010-88085344

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（三）注册登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

法定代表人：李维雄

联系人：肖向辉

电话：010-66295871

传真：010-66578680

网址：www.orient-fund.com

（四）律师事务所和经办律师

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军 李晓明

（五）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所有限公司

住所：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

办公地址：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅



电话：010-68015062

传真：010-68018480

经办注册会计师：王友业、王云成

## 六、基金的募集与基金合同的生效

（一）本基金根据 2008 年 10 月 15 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方稳健回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】1188 号）及《关于东方稳健回报债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2008】473 号）的批准，并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。

（二）本基金类型：债券型

本基金存续期间：不定期

（三）本基金募集期为：2008 年 11 月 10 日至 2008 年 12 月 5 日

募集份额为：1,018,882,238.14 份

有效户数为：12,608 户

（四）本基金根据《关于东方稳健回报债券型证券投资基金备案确认的函》（基金部函【2008】520 号）的批准，于 2008 年 12 月 10 日基金合同生效。

本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

## 七、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

1. 本基金管理人的直销网点。

2. 经本基金管理人委托，具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即代销机构销售网点。目前的代销机构为中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、北京银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、国

元证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、江海证券经纪有限责任公司、宏源证券股份有限公司。以上代销机构的住所同第五章所述。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。

3. 投资者可通过本基金直销机构或指定的代销机构按照规定的方式进行申购或赎回。

#### （二）申购和赎回的开放日及时间

1. 本基金办理日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日（本基金管理人公告暂停时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9:30-11:30，下午 1:00-3:00。

2. 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原因，基金管理人可对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并于实施前在中国证监会指定媒体上公告。

3. 投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回视为下一开放日的交易申请。

4. 本基金自 2008 年 12 月 10 日开始正常申购；自 2008 年 12 月 10 日开始正常办理赎回。

#### （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “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. 投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

#### （四）申购与赎回的程序

### 1. 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，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. 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记结算机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以登记结算机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金登记结算机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。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。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1. 投资者每次最低申购金额为1,000.00元（含申购费）。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于500.00份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足500.00份的，在赎回时需一次全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

#### （六）申购费用和赎回费用

1. 投资者在申购时需交纳前端申购费，具体如下：

申购金额(含申购费)	前端申购费率
10 万元以下	0.8%
10 万元以上(含 10 万元)-100 万元以下	0.5%
100 万元以上(含 100 万元)-500 万元以下	0.3%
500 万元以上(含 500 万元)	每笔 1,000.00 元

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2. 投资者在赎回时需交纳赎回费，费率按持有时间递减，具体如下：

持有期限 (一年按 365 天计)	赎回费率
30 天以内	0.30%
30 天以上(含 30 天)-1 年以下	0.10%
1 年以上(含 1 年)-2 年以下	0.05%
2 年以上(含 2 年)	0.00%

其中，所收取赎回费总额的 25% 归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

3. 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。

4. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### (七) 申购份额与赎回金额的计算

##### 1. 本基金申购份额的计算

(1) 申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \{ \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率}) \} * \text{前端申购费率}$$

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

申购份数 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

(2) 申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

前端申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份数 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

(3) 申购费用和申购份数的计算采用截位法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例二：假定 T 日基金的基金份额净值为 1.1 元。四笔申购金额分别为 2,000.00 元、20 万元、200 万元和 2000 万元，申购本基金，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额(元, a)	2,000.00	200,000.00	2,000,000.00	20,000,000.00
适用的前端申购费率(b)	0.8%	0.5%	0.3%	---
前端申购费(c={a/(1+b)}*b)	15.87	995.02	5,982.05	1,000.00
净申购金额(d=a-c)	1,984.13	199,004.98	1,994,017.95	19,999,000.00
适用的基金份额净值(e)	1.10	1.10	1.10	1.10
申购份数(=c/e)	1,803.75	180,913.62	1,812,743.59	18,180,909.09

## 2. 本基金赎回金额的计算

(1) 赎回金额的计算方法如下：

赎回金额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

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

例三：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份基金份额，持有期限 2 个月(60 天)，该日基金份额净值为 1.250 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额 = 10,000 × 1.250 = 12,500.00 元

赎回费用 = 12,500 × 0.1% = 12.50 元

净赎回金额 = 12,500 - 12.50 = 12,487.50 元

(2) T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日公告。基金份额净值计算公式

为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）申购和赎回的注册与过户登记

投资者申购基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者登记权益并办理登记结算手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者办理扣除权益的登记结算手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 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。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并予以公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据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支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

#### (十二) 其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购和/或赎回的情形，基金管理人在报中国证监会核准或备案后应当立即在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购和/或赎回公告。

#### (十三) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次，当连续暂停时间超过两个月时，重复刊登暂停公告的频率可调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站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近一个开放日的基金份额净值。

#### (十四) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十五) 基金的非交易过户



基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十六）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

#### （十七）定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人，本基金自2008年12月22日起在中国建设银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司和兴业证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、2009年2月9日起在招商证券股份有限公司、2月11日起在中信银行股份有限公司、6月30日起在齐鲁证券有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司等销售渠道开始办理定期定额投资业务（前端），未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

#### （十八）基金的冻结及解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 八、基金的投资

### （一）投资目标

在控制风险和确保资产流动性的前提下，追求较高总回报率，力争实现基金资产长期稳定增值。

## （二）投资范围

本基金为债券型基金，主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换公司债券（含可分离交易债券）、资产支持证券、债券回购等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金还可投资于一级市场新股网上申购，公开增发新股、可转换债券转股、股票或可分离交易债券派发的权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类金融工具。为降低权益类头寸波动对基金收益的影响，因上述原因持有的股票，本基金将在其上市后的60个交易日内卖出，被动持有的权证在其上市后10个交易日内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他创新的证券品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中，信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的50%，可转换债券的比例不超过基金资产的30%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

## （三）投资策略

本基金奉行“积极投资、稳健增值”的投资理念，在保持组合较低波动性的同时，采用稳健的资产配置策略和多种积极管理增值手段，实现较高的总回报率。

### 1. 固定收益类资产投资策略

#### （1）利率预期策略

利率预期策略是债券型基金采用的最基本的策略，主要通过对组合久期的控制实现对利率风险的有效管理。本基金以“目标久期”管理作为利率预期策略的核心内容，通过深入研究宏观经济运行态势和宏观政策导向，判断市场利率变动的趋势和幅度。运用敏感性分析，模拟利率变动的多种可能性，测算业绩比较基准与投资组合在利率变动情况下，由久期驱动的损益状况，并根据投资组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。

具体来说，“目标久期”的确定包括以下三个方面：

第一，宏观经济分析。基准利率的变动是由一国的宏观经济发展状况所决定的，因此，

宏观经济的研判是债券投资的首要任务。本基金对反映宏观经济变化的各种变量，如消费、投资、进出口、资金流向等因素进行持续的跟踪与分析，考察宏观经济的运行趋势及在经济周期中所处的地位，合理预期宏观经济政策（包括财政与货币政策）的最新取向。

第二，市场利率变动趋势分析。市场利率的变动主要体现为对未来政策（尤其是货币政策）的预期，而宏观政策的变动取决于宏观经济的发展态势。本基金除密切关注宏观经济数据，还将目前的经济数据表现与历史的经济周期进行比较，判断当前的宏观环境对市场利率的影响方向和幅度，以及投资人的一致预期如何影响市场利率变动的的时间和方式。

第三，目标久期分析。根据对市场利率变动趋势、利率所处经济周期的分析，并结合当前市场的利率水平，确定组合目标久期变动的方向。一般来说，在利率上行通道中，应缩短目标久期以规避利率风险；在利率下行通道中，应拉长目标久期以享受债券价格上涨带来的收益。本基金在预测目标久期变动方向之后，运用敏感性分析，模拟利率变化幅度的多种可能性，考察比较基准与投资组合在利率变动时的风险收益特征，确定组合的目标久期区间，有效控制风险，获取投资收益。

#### (2) 收益率曲线策略

收益率曲线的变动可以分为平行移动和非平行移动两种。平行移动指各期限的收益率对于利率变动做出相同幅度的变化，包括向上平行移动和向下平行移动；而非平行移动则指各期限收益率对于利率变动产生不同的调整幅度，收益率曲线的斜率、形状都会发生变化。实际上，收益率曲线经常呈现非平行化移动。

如果收益率曲线不是平行移动，则久期相同的投资组合的表现可能差异较大。本基金在久期确定的前提下，根据收益率曲线非平行变化的预期，通过各种情景分析，进一步优化组合的期限结构。具体有三种方式可以选择：子弹策略、哑铃策略和梯形策略。子弹策略将各个债券的偿还期限高度集中于收益率曲线上的一点；哑铃策略将债券的偿还期限集中于收益率曲线的两个极端；梯形策略则让每个偿还期限的债券所占比重相当。在选用具体的策略时，本基金会综合考虑通胀的短期和长期趋势、各个期限结构债券的收益变化特性等因素，构建合适的期限组合。

#### (3) 债券类属配置策略

在确定组合久期和期限结构配置的基础上，本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的利差情况，以及交易所和银行间两个市场间同一交易品种的利差，制定债

券类属配置策略，获取不同债券类属之间利差变化所带来的较高投资收益。

此外，随着债券市场的不断深入发展，本基金将加强对资产支持证券等创新品种的投资，获取超额收益。

#### (4) 骑乘策略

当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

#### (5) 信用投资策略

信用债券投资是利率风险管理与信用风险管理相结合的投资策略，是本基金提高固定收益类投资总回报率的主要增值方式。具体来说，本基金对信用债券的投资包含个券精选策略和利差交易策略，其中，对个券的筛选是信用投资策略的基石。本基金采取自上而下的分析方法，通过对宏观经济运行、行业发展前景、企业自身状况等多重因素的综合考量对企业进行评分，并在评分的基础上，建立信用债券债券池，然后，根据既定的目标久期进行个券和利差的投资。

##### ① 个券精选策略

首先，根据对未来宏观经济运行态势的预测、行业发展前景的研判，全面评价企业经营的宏观环境，并给出一个综合的分值，这部分分值在评分体系中的权重为 40%。

其次，利用公开的信息，充分衡量债券发行人的监管环境、公司背景、竞争优势、治理结构等基本面信息，分析企业的长期经营风险，这部分分析仅针对企业债、公司债等中长期债券，而不适用于短期融资券等短期信用债券。在长期信用债券的评分体系中，这部分分值所占的权重为 10%。

再次，运用成熟的ZETA评分模型评价债券发行人的财务风险，利用资产收益率、收益稳定性指标、债务偿付能力指标、累计盈利能力指标、流动性指标、资本化程度的指标、规模指标这七个变量进行综合评分。在长期信用债券的评分体系中，这部分分值所占的权重为 50%；在短期信用债券的评分体系中，这部分分值所占的权重为 60%。

最后，将每个债券发行人的各部分分值予以汇总，将评分由高到低划分为 A、B、C、D、

E 五个等级，评分越高，表明信用风险越小，投资的安全性越高。评分在 E 以上的债券可以进入信用债券债券池，成为本基金投资的对象。

## ②利差交易策略

信用债券相对于国家债券（国债、央行票据等），存在着流动性风险和信用风险，这集中体现为信用债券对同期限无风险利率的利差。根据历史的数据，不同期限、不同等级的信用债券具有稳定的利差，当利差与历史均值出现较大偏离时，往往意味着投资机会。本基金将利用市场的相对失衡，买入利差扩大的信用债券，卖出利差缩小的信用债券，获得利差向均值回归带来的资本利得收益。

## (6) 回购放大策略

回购放大是一种杠杆投资策略，通过质押组合中的持仓债券进行正回购，将融得资金购买债券，获取回购利率和债券利率的利差，取得高于资产规模所能支撑的收益率。回购放大可以通过数次层层迭代，放大的倍数取决于对回购利率的判断与把握。影响回购放大策略的关键因素有两个，一是回购资金成本与债券收益率的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本时，放大策略才能取得正的回报；其次，当放大倍数超过 1 时，应确保现金流的前后衔接，使得放大策略可以持续进行。

该策略在资金相对充裕的情况下是风险很低的投资策略。本基金是债券型基金，在银行间正回购的比例上限为 40%，杠杆率相对较高，基金管理人会在无新股发行期间，利用市场利率的平稳时期，使用基础组合持有的债券进行回购放大，融入短期资金滚动操作，同时选择 2 年以下的短期债券进行投资，获取利差收益。

## (7) 可转债投资策略

可转债不同于一般的企业债券，投资人在一定条件下具有转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资可转债的主要目标是降低基金净值的下行风险，通过投资可转债转换成股票，保留参与股票价格上涨的潜在收益。总体来看，本基金的可转债投资有两个基本思路：

第一，积极投资策略。本基金采取积极管理策略，重视对可转债对应股票的分析与研究，主要对公司的基本面深入研究，包括其所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转债的股权投资价值，采用期权定价模型，估算可转债的转换期权价值，选择具有较高投资价值的可转债。

第二，一级市场申购策略。目前，可转债均采用定价发行，对于发行条款优惠、期权

价值较高、公司基本面优良的可转债，因供求的失衡，会产生较大的一、二级市场价差。因此，为增加组合收益，本基金将在充分研究的前提下，参与可转债的一级市场申购，在严格控制风险的前提下获得稳定收益。

本基金持有的可转债转股后，将在转股后的 60 个交易日内卖出持有的股票。

#### (8) 资产支持证券投资策略

资产支持证券是固定收益产品中较为复杂的品种。自 2005 年以来，我国有多单资产支持证券产品问世，大体来看，主要分为两类：第一类是企业将应收帐款等资产打包，设计出证券化产品；第二类是银行将个人抵押贷款、汽车贷款、不良贷款等资产打包，形成证券化产品。从规模上看，显然后一类银行作为发起人推行的证券化产品规模较大，但无论哪类产品，目前的市场流动性都比较差。

考虑到资产支持证券产品目前的特性，此时投资资产支持证券，采取的是一种买入持有策略，着重资产支持证券相对于其他债券品种的较高收益率溢价，以流动性换取收益性，在资产规模稳定、赎回压力较小、低利率周期的条件下适用于这种策略。展望未来，资产证券化市场的发展必将日益完善，向美国等发达市场靠拢，到那时，资产支持证券流动性大大增强，投资策略也将更加灵活。

### 2. 权益类资产投资策略

#### (1) 新股申购策略

本基金可以参与一级市场新股申购或公开增发新股。由于一级市场股票供应的稀缺性，股票上市后的溢价使得新股申购成为一种低风险的投资策略。当股票市场呈现上涨趋势时，网下申购新股的收益率高于网上，但当股票市场持续下跌时，网下申购将获得负的收益率。与网下申购相比，网上申购在上市短期内卖出股票所获得的收益率较低，但相对稳定，风险较小。因此，本基金为确保基金收益的低波动性，仅进行网上申购。

本基金从公司基本面、新股内在价值、申购收益率测算等四个方面制定投资策略。

第一，公司基本面分析。本基金通过对发行新股公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力等方面展开分析，选择具有成长空间的行业中盈利能力稳定、偿债风险较低的公司，同时，结合公司的发展战略、内部组织控制等因素，确定公司基本面的状况。

第二，新股内在价值分析。采用定量的方法，从绝对价值和相对价值两方面测算新股的内在价值。首先，运用现金流贴现、EVA 等定价模型，评估公司股票的绝对价值；其次，结合 PE、PB 等相对价值方法，参考同类上市公司的估值水平，综合确定新股的上市价格。

第三，申购收益率测算。本基金只能参与新股网上申购，根据以往新股申购的中签率以及上市首日涨幅，结合当前市场的资金面，测算出新股申购的收益率区间。当新股申购的预期收益率高于资金成本时，参与新股申购。多只新股同时发行时，选择预期收益率最高的新股优先申购。

第四，参与规模与退出时机。本基金综合考虑新股预期收益率、新股发行的节奏以及基金目前的股票仓位等因素，确定参与申购的资金规模。预期新股的收益较为可观时，应动用组合中较大比例的资金进行申购，反之，则应适当参与。

基金持有的新股将在其可交易之日起，根据新股上市后股票市场整体的运行态势、发行公司所处行业的景气度变化等因素，在 60 个交易日内择机卖出。

#### （2）权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证，仅被动持有股票或可分离交易债券派发的权证，在其上市后 10 个交易日内择机卖出。

本基金在控制风险与获取稳定收益的前提下，对权证进行投资。运用期权定价模型确定权证的理论价值基准，同时结合权证标的股票的价格走势进行趋势分析，确定权证的参与规模与退出时机。

#### （四）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债总指数。

中债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性，并得到市场和投资者的广泛认可，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更加适用于本基金的业绩基准的债券指数时，基金管理人可根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更业绩比较基准。基金管理人经与托管人协商一致，报中国证监会备案后及时对外公告。

#### （五）风险收益特征

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险和预期收益率低于直接参与二级市场股票、权证投资的债券型基金，高于纯债券型基金。

## （六）投资限制

### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资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) 本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%；

(4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(6) 本基金投资于信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的 50%；

(7) 本基金投资于可转换债券的比例不超过基金资产的 30%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 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；

(11) 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。



因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### （七）基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1. 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；
2. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
3. 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；
4. 有利于基金财产的安全与增值；
5. 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。

### （八）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

### （九）基金投资组合报告

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

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2009年9月30日（财务数据未经审计）。

#### 1. 投资期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,661,974.45	8.40
	其中：股票	23,661,974.45	8.40
2	固定收益投资	236,761,244.31	84.02
	其中：债券	236,761,244.31	84.02
	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	12,405,891.33	4.40
6	其他资产	8,972,117.41	3.18
7	合计	281,801,227.50	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	22,552,034.45	9.10
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,380,870.00	2.17
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	5,040,204.50	2.03
C7	机械、设备、仪表	12,130,959.95	4.89

C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,052,160.00	0.42
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	43,880.00	0.02
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	13,900.00	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	23,661,974.45	9.55

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000527	美的电器	674,296	11,665,320.80	4.71
2	600596	新安股份	121,000	5,380,870.00	2.17
3	600219	南山铝业	356,294	3,402,607.70	1.37
4	000778	新兴铸管	162,460	1,637,596.80	0.66
5	601668	中国建筑	198,000	918,720.00	0.37
6	002031	巨轮股份	49,077	439,239.15	0.18
7	601618	中国中冶	24,000	133,440.00	0.05
8	601788	光大证券	2,000	43,880.00	0.02
9	300003	乐普医疗	500	14,500.00	0.01
10	300008	上海佳豪	500	13,900.00	0.01

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	57,837,000.00	23.34
2	央行票据	19,934,000.00	8.04
3	金融债券	37,912,000.00	15.30
	其中：政策性金融债	37,912,000.00	15.30
4	企业债券	115,372,444.21	46.55
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	5,705,800.10	2.30
7	其他	-	-

8	合计	236,761,244.31	95.53
---	----	----------------	-------

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	090401	09农发01	400,000	37,912,000.00	15.30
2	080023	08国债23	300,000	29,040,000.00	11.72
3	080026	08国债26	300,000	28,797,000.00	11.62
4	122972	09绵投控	250,050	24,754,950.00	9.99
5	122986	09春华债	213,970	20,669,502.00	8.34

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	4,500,012.26
3	应收股利	-
4	应收利息	4,157,521.65
5	应收申购款	64,583.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,972,117.41

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	4,640,220.00	1.87

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300003	乐普医疗	14,500.00	0.01	未上市
2	300008	上海佳豪	13,900.00	0.01	未上市

## 九、基金的业绩

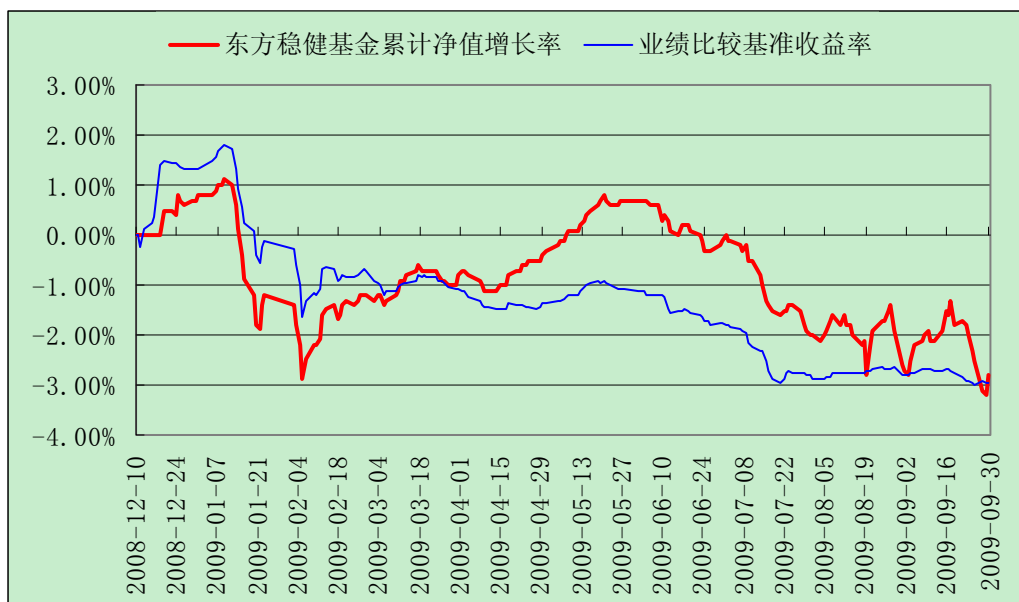
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### (一) 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008/12/10-2008/12/31	0.80%	0.17%	1.31%	0.22%	-0.51%	-0.05%
2009/1/1-2009/6/30	-0.89%	0.19%	-3.04%	0.14%	2.15%	0.05%
2009/7/1-2009/9/30	-2.70%	0.25%	-1.21%	0.06%	-1.49%	0.19%

### (二) 本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：①根据《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中，信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的50%，可转换债券的比例不超过基金资产的30%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本报告期内，本基金严格执行了《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》的相关规定。

②本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金合同生效日为2008年12月10日，至披露时点满一年。

③所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 十、基金的财产

### （一）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。

### （二）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。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、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、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自

有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （二）估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(1)交易所上市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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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) 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，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，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。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### （四）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外



公布。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。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1. 差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

##### 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当

事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；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。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管

理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它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；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(八) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。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。

## 十二、基金的收益与分配

(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. 银行存款利息；
  4. 已实现的其他合法收入；
  5. 持有期间产生的公允价值变动。
- 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国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

## （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
3. 本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 60%；
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
5. 本基金收益分配方式为现金分红，投资人可选择将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
6. 基金投资当期出现累计净亏损，则不进行收益分配；
7. 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
8. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
9. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （四）收益分配方案

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

## （五）收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

# 十三、基金的费用与税收

## （一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；

2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

（三）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，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的

规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、基金的会计与审计

（一）基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
3. 本基金的会计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的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人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；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

（二）基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

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。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 十五、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 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。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

（二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

（四）基金合同生效公告

基金管理人将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。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

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

3. 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。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，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。

（六）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、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。

（七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 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报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 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报刊上；

3. 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报刊和网站上；



4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

5. 基金定期报告应当按有关规定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。

#### （八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
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. 基金变更、增加或减少代销机构；

20. 基金更换注册登记机构；
21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （十）基金份额持有人大会决议

#### （十一）中国证监会规定的其他信息

#### （十二）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。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。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十六、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为债券投资风险和股票投资风险。

#### （1）债券投资风险主要包括：

##### ①利率风险

市场利率波动会导致债券市场的收益率和价格的变动，如果市场利率上升，本基金持有

债券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，债券利息的再投资收益将面临下降的风险。

②收益率曲线风险

如果基金对长、中、短期债券的持有结构与基准存在差异，长、中、短期债券的相对价格发生变化时，基金资产的收益可能低于基准。

③利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

④信用风险

基金在交易过程中发生交收违约，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，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成基金资产损失的风险。

⑤市场供需风险

如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，债券市场参与主体可用资金数量和债券市场可供投资的债券数量可能发生相应的变化，最终影响债券市场的供需关系，造成基金资产投资收益的变化。

⑥购买力风险

基金投资所取得的收益率有可能低于通货膨胀率，从而导致投资者持有本基金资产实际购买力下降。

(2) 股票投资风险主要包括：

①国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

②宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

③上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

(二) 流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

### （三）积极管理风险

在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

### （四）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

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

### （五）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 十七、基金的终止与清算

### （一）基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1. 基金份额持有人大会决定终止的；
- 2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3. 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，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4. 中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人

员。

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

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

## 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

# 十八、基金合同的内容摘要

## （一）基金合同当事人权利及义务

### 1. 基金管理人的权利与义务

#### （1）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

①自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

②依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

③发售基金份额；

④依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

⑤在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

⑥根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

⑦在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

⑧在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

⑨自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

⑩选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

⑪选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

⑫在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

⑬依法召集基金份额持有人大会；

⑭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

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 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，分别记账，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计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- ⑨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；
- ⑩按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- ⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- ⑫编制中期和年度基金报告；
- ⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- ⑭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；
- ⑮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；
- ⑯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；
- ⑰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；
- ⑱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；
- ⑲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；



⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

㉒按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

㉓面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

㉔执行生效的基金份额持有人大会决议；

㉕不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

㉖依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

㉗法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 2. 基金托管人的权利与义务

### (1) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

①依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

②监督基金管理人对本基金的投资运作；

③自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

④在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

⑥依法召集基金份额持有人大会；

⑦按规定取得基金份额持有人名册资料；

⑧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

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

①安全保管基金财产；

②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；

③对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

④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；

⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

⑥按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

⑦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和有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

⑧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；

⑨保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

⑩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；

⑪办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

⑫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；

⑬按照规定监督基金管理人的投资运作；

⑭按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

⑮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；

⑯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；

⑰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；

⑱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；

⑲参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；

⑳面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

㉑执行生效的基金份额持有人大会决议；

㉒不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

㉓建立并保存基金份额持有人名册；

②法律法规、中国证监会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) 基金份额持有人的权利

- 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法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (2) 基金份额持有人的义务

- ①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- ②交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用；
- ③在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- ④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- ⑤执行生效的基金份额持有人大会决议；
- ⑥返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- ⑦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组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

##### 1. 召开事由

- (1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额

10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当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变更基金类别；
- ④变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- ⑤变更基金份额持有人大会程序；
- ⑥更换基金管理人、基金托管人；
- ⑦提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- ⑧本基金与其他基金的合并；
- ⑨对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- ⑩法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(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基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- ①调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- ②在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- ③因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- ④对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- ⑤基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- ⑥按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2. 召集人和召集方式

①除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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 10 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 60 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 10 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 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 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 60 日内召开。

④代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

### 3. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- ①会议召开的时间、地点和出席方式；
- ②会议拟审议的主要事项；
- ③会议形式；
- ④议事程序；
- ⑤有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- ⑥代理投票的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；
- ⑦表决方式；
- ⑧会务常设联系人姓名、电话；
- ⑨出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- ⑩召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人, 还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金托管人, 则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金份额持有人, 则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

#### 4. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

① 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

② 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

③ 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

④ 会议的召开方式由召集人确定。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

###### <1> 现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%, 下同)

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备, 到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定, 并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

###### <2> 通讯开会方式

在同时符合以下条件时, 通讯会议方可举行:

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后, 在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额

持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

⑤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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 5. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

①议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

②基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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。

③对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

④单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，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 6 个月。法律法规另有规定的除外。

⑤基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

(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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

② 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

6. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

① 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

② 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

③ 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。



④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基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

⑥基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7. 计票

### (1) 现场开会

①如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行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，由大会主持人当场公布计票结果。

③如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 8. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者

出具无异议意见之日起生效。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

9. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### （三）基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1. 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

① 基金份额持有人大会决定终止的；

② 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

③ 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，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

④ 中国证监会规定的其他情况。

#### 2. 基金财产的清算

##### （1）基金财产清算组

① 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

② 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

③ 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

##### （2）基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- ①基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- ②基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ③对基金财产进行清理和确认；
- ④对基金财产进行估价和变现；
- ⑤聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑥聘请律师事务所出具法律意见书；
- ⑦将基金财产清算结果报告中国证监会；
- ⑧参加与基金财产有关的民事诉讼；
- ⑨公布基金财产清算结果；
- ⑩对基金剩余财产进行分配。

### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款①—③项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## (四) 争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 十九、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：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

邮政编码：100140

法定代表人：李维雄

总经理：单宇

成立日期：2004 年 6 月 11 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】80 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：50 年

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

#### 2. 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：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

成立时间：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；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；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金为债券型基金，主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换公司债券（含可分离交易债券）、资产支持证券、债券回购等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金还可投资于一级市场新股网上申购，公开增发新股、可转换债券转股、股票或可分离交易债券派发的权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类金融工具。为降低权益类头寸波动对基金收益的影响，因上述原因持有的股票，本基金将在其上市后的60个交易日内卖出，被动持有的权证在其上市后10个交易日内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他创新的证券品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中，信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国

证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的 50%，可转换债券的比例不超过基金资产的 30%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- ① 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- ② 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- ③ 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- ④ 本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- ⑤ 本基金投资于信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的 50%；
- ⑥ 本基金投资于可转换债券的比例不超过基金资产的 30%；
- ⑦ 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- ⑧ 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- ⑨ 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- ⑩ 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- ⑪ 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；
- ⑫ 如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交

易日内进行调整。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性,并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生,如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易,基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生,只能进行事后结算,基金托管人不承担由此造成的损失,并向中国证监会报告。

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(5) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(6) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(7) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

(8) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(9) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

(10) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1. 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安



全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，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给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

3. 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产保管

##### 1. 基金财产保管的原则

- ①基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- ②基金托管人应安全保管基金财产。
- ③基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- ④基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- ⑤基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- ⑥对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

⑦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. 基金募集期间及募集资金的验资

①基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

②基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

③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等事宜。

### 3. 基金银行账户的开立和管理

①基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

②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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

③基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

④在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

①基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

②基金证券账户的开立和使用，仅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或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

③基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

④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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中

国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

⑤若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6. 其他账户的开立和管理

①因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

②法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、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。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8. 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。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### （五）基金资产净值计算与复核

#### 1. 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金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

## 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，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。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## （六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人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。

## （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，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，仲裁费用由败诉方承担。

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本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。

## （八）托管协议的变更与终止

### 1. 托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### 2. 基金托管协议终止出现的情形

- (1) 基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

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

### （一）开户确认

基金管理人为投资者提供开户信息的短信确认及网上查询确认服务，投资者可通过接收公司的开户确认短信或者登陆公司网站了解相关的开户信息。

### （二）资料发送

#### 1. 基金投资人对账单

基金管理人根据基金份额持有人提出的要求，为其提供对账单寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息，基金管理人同时为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过公司网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息，我们将按投资人要求定期为其发送电子对账单。

#### 2. 其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别，寄送公司期刊及各类研究报告，动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### （三）呼叫中心服务

东方呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询，

在这过程中客户有任何需要帮助的地方，均可以转接人工或在语音信箱中留言；系统同时受理 E-Mail 等多样化服务，为客户提供便捷多样的交流方式。

#### （四）网上交易业务

本基金已开通网上交易业务，个人投资者可通过本公司网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务，本公司在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动，个人投资者通过本公司网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠，详情可登陆本公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 查阅本公司旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

#### （五）网上查询服务

通过本公司网站，客户还可获得如下服务：

##### 1. 查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

##### 2. 信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

#### （六）短信服务

本公司已经开通短信服务，通过短信向投资者发送本公司基金、公司活动等内容的相关信息。

#### （七）资讯服务

投资者如果想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，可拨打本公司如下电话：

电话呼叫中心：010-66578578，该电话可转人工座席。

传真：010-66578700

#### （八）定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人，本基金自2008年12月22日起在中国建设银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司和兴业证

券股份有限公司、广发证券股份有限公司、2009年2月9日起在招商证券股份有限公司、2月11日起在中信银行股份有限公司、6月30日起在齐鲁证券有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司等销售渠道开始办理定期定额投资业务（前端），未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

#### （九）基金转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，基金投资者可以选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定。

#### （十）客户投诉受理服务

投资者可以通过客户服务热线（010-66578578）、公司网站（www.orient-fund.com）、电子邮件（services@orient-fund.com）、传真、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见，并按照“客户投诉和建议”流程处理，在规定的时间内予以反馈。

#### （十一）投资顾问服务

本公司拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队，分布于北京、上海等地区，致力于为客户提供优异的个性化理财服务。

## 二十一、其他应披露事项

（一）在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

（二）基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定（包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充）。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了本基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成决议。本基金托管人不受《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的限定。

（三）本《招募说明书》将按中国证监会有关规定定期进行更新；招募说明书解释与基金合同不一致时，以本基金基金合同为准。

（四）从上次招募说明书（更新）截止日2009年6月10日到本次《招募说明书（更新）》截止日2009年12月10日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
本公司关于延长旗下基金在中国邮政储蓄银行定期定额投资申购费率优惠时间的公告	2009-6-26
本公司关于旗下基金在齐鲁证券开通定期定额投资业务的公告	2009-6-27
本公司旗下基金截止2009年6月30日基金净值公告	2009-7-1
本公司上海分公司成立公告	2009-7-13
本基金2009年第2季度报告	2009-7-21
本基金招募说明书（更新）摘要（2009年第1号）	2009-7-24
本基金招募说明书（更新）（2009年第1号）	2009-7-24
本公司关于旗下基金参与中信银行开展的网上交易申购费率优惠活动的公告	2009-7-31
本公司关于旗下基金开通民生银行网上交易的公告	2009-8-4
本公司关于网上交易平台开通民生银行定期定额投资业务的公告	2009-8-4
本公司关于总经理任职的公告	2009-8-18
本基金2009年半年度报告（正文）	2009-8-27
本基金2009年半年度报告（摘要）	2009-8-27
本公司关于旗下基金在江海证券开通定期定额投资业务的公告	2009-9-7
本公司关于旗下基金参加齐鲁证券开展的基金网上申购费率优惠的公告	2009-9-9
本公司关于旗下基金参与创业板投资及相关风险揭示的公告	2009-9-23
本基金2009年第3季度报告	2009-10-28
本公司关于旗下基金增加宏源证券股份有限公司为代销渠道的公告	2009-11-5
本公司关于旗下基金在国信证券开通定期定额投资业务的公告	2009-11-19

## 二十二、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的办公地址，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十三、备查文件

- （一）中国证监会批准东方稳健回报债券型证券投资基金募集的文件
- （二）《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《东方稳健回报债券型证券投资基金托管协议》



- （四）《东方稳健回报债券型证券投资基金法律意见书》
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

东方基金管理有限责任公司

2010年1月22日