（上接D15版）

(14)重大关联交易事项；
(15)基金收益分配事项；
(16)管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
(17)基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
(18)基金改聘会计师事务所；
(19)变更、增加、减少基金份额代销机构；
(20)更换基金注册登记机构；
(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)中国证监会规定的其他事项。

9、澄清公告

在本基金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。

10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前40日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

11、中国证监会规定的其他信息

（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、有关销售机构及其网点，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至少一种指定媒体上公告。

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

基金风险则基金收益的不确定性，所有可能影响基金业绩的因素都属于风险的来源，而风险管理本质上就是在一定约束条件下对预期收益和预期风险的平衡。科学严谨的风险管理对基金投资管理绩效至关重要，与投资者利益休戚相关，因此对风险的识别、评估和控制应贯穿基金投资的全过程。

本基金风险按来源划分，主要包括系统性风险、非系统性风险、流动性风险、基金管理风险以及本基金的特定风险。

（一）系统性风险

本基金投资于证券市场，系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险和购买力风险等。

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规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

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

4、购买力风险

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

5、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

6、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升带来的价格风险互为消长。

（二）非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

1、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使基金投资收益下降。本基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

2、信用风险

信用风险指债券发行人出现违约、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的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

（三）流动性风险

本基金类型为契约型开放式，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而波动，基金投资人的连续大量赎回申请产生的仓位调整可能使资产难以按照预先期望的成交价格变现而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

（四）基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。或公司内部失控而导致基金财产损失的风险。

2、交易风险

在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

（五）本基金的特定风险

本基金作为股票型基金，在投资管理中会至少维持60%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险。基金虽然通过规范的价值分析手段投资于价值被低估的股票，但并不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场大幅上涨时也不能完全保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

（六）其他风险

主要是由其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等有可能导致基金财产损失或影响基金收益水平。

十七、基金的终止与清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；
2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
3、《基金合同》约定的其他情形；
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止情形发生时，应当按法律法规和本基金基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，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财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

5、基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
(3)对基金财产进行估值和变现；
(4)制作清算报告；
(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；
(7)对基金财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月。

（三）清算费用

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

（四）基金剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（五）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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小组进行公告。

（六）基金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）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人：江先周
成立时间：2005年9月19日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监基金字[2005]158号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币2亿元
存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：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
法定代表人：姜建清
成立时间：1984年1月1日
批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
注册资本：人民币334.018.850.026元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号

3、基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

4、基金管理人的权利与义务

(1)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
1)依法募集基金；
2)自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
4)销售基金份额；
5)召集基金份额持有人大会；
6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
7)在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
8)选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
11)在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
12)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
13)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；
14)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；
15)以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与基务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
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、谨慎勤勉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基金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，不得利用基金财产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)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，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
10)编制半年度和年度基金报告；
11)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；
12)保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；
13)按《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基金收益；
14)按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
17)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，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
18)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；
19)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；
20)因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
23)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实施其他法律行为；
24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
25)执行生效的基金份额持有人大会的决定；
26)建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5、基金托管人的权利与义务

(1)根据《基法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：
1)自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
2)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；
3)监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
4)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；
5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；
7)提议召开或召集基金份额持有人大会；
8)在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
2)设立专门的基金托管部门，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)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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
4)除依据《基法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
7)保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
10)对基金财务会计报告、季度、半年度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；如果基金管理人有未执行《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；
11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
12)建立并保存基金份额持有人名册；
13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
14)按照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；
15)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；
16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
17)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；
18)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监管机构，并通知基金管理人；
19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
21)执行生效的基金份额持有人大会的决定；
22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

6、基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的合法权益。

(1)根据《基法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
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、基金销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。

(2)根据《基法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：
1)遵守《基金合同》；
2)缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
3)在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
4)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
5)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
6)执行生效的基金份额持有人大会的决定；
7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（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的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1、召开事由

(1)当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
1)终止《基金合同》；
2)更换基金管理人；
3)更换基金托管人；
4)转换基金运作方式；
5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
6)变更基金类别；
7)本基金与其他基金的合并；
8)变更基金投资目标、范围或策略；
9)变更基金份额持有人大会程序；
10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
11)单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
13)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2)以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
1)调低基金管理费、基金托管费；
2)法律法规要求增加的基金费用的收取；
3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
6)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(2)关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自该决议生效之日起在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：
(1)基金份额持有人大会决定终止的；
(2)基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
(3)《基金合同》约定的其他情形；
(4)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(4)基金财产清算程序：
1)《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
3)对基金财产进行估值和变现；
4)制作清算报告；
5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
6)将清算报告报中国证监会备案并公告；
7)基金财产清算的期限为6个月。

5、清算费用

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

6、基金财产清算的剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

7、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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小组进行公告。

8、基金财产清算的保存

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：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人：江先周
成立时间：2005年9月19日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158号
注册资本：2亿元人民币
组织形式：有限责任公司
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会批准的其他业务
存续期间：持续经营
电话：010-66228888
传真：010-66228889
联系人：路彩营

2.基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）
法定代表人：姜建清
电话：010-66106912
传真：010-66106904
联系人：蒋松云
成立时间：1984年1月1日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币334.018.850.026元
批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
存续期间：持续经营
经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

(1)《基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

(2)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

①按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-95%，其中投资于内生动力行业（包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业）的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于80%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，资产支持证券占基金资产净值的比例为0-20%，权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

②根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为60%-95%；

b、本基金持有的现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%；

c、本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

d、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%；

e、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

f、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

g、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

h、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%；

i、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%；

j、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%；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%；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%；

k、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；

l、本基金持有的债券其信用级别不低于BBB级；

m、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；

n、本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；

o、法律法规及中国证监会规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

基金托管人对基金的投资的监督和检查目本基金合同生效之日起开始。

③法规允许的基金投资比例调整期限

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约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

④本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

⑤相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

(3)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

①承销证券；
②向他人贷款或提供担保；
③从事可能使基金承担无限责任的投资；
④买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
⑤向基金管理人、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债券；
⑥买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
⑧当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4)基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5)基金托管人依据有关法律法规的规定和《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。

①基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

③基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

(6)基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款时应由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

(7)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

①基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

②流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

③基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式进行确认。

④基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

⑤基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应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。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或承诺。

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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内