(上接D5版)

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵规守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

（1）控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

（2）公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

（3）公司健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

（4）公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、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）公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

a、各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

b、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

c、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；

d、公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力；

e、公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；

f、授权控制贯穿于公司经营活动的始终，通过完善法人治理结构、明确各部门职能与授权范围来完成；

g、公司建立完善的资产分离制度，基金财产与公司资产、不同基金的财产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算；

h、公司建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离；

i、公司制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序；

j、公司维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统；

k、公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

6、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确。

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司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

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
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
成立时间：1984年1月1日
注册资本：人民币334，018，850，026元
存续期间：持续经营
组织形式：股份有限公司
联系人：蒋松云
联系电话：010-66105799

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）主要人员情况

截至2010年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工125人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2010年3月，托管证券投资基金152只，其中封闭式9只，开放式143只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得22项国内外大奖。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2008年，中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证SAS70（审计标准第70号）。通过SAS70国际专项认证，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，已经启动SAS70审计年度化、常规化的项目。

1、内部控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制情况

资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资是否符合有关法律法规的规定及基金合同的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

五、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构：

（1）中海基金管理有限公司
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
电话：021-68419518
传真：021-68419328
联系人：周颖
客户服务电话：400-888-9788
公司网址：www.zhfund.com

（2）中海基金管理有限公司北京分公司
办公地址：北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F218
电话：010-66493583
传真：010-66425292
联系人：邹意
客户服务电话：400-888-9788
公司网站：www.zhfund.com

2、代销机构：

（1）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
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
电话：010-66105799
传真：010-66105798
联系人：蒋松云
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
联系人：滕涛
传真：010-85109219
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（3）交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：021-58781234
传真：021-58408842
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（4）招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：秦晓
传真：0755-83195049
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

（5）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
法定代表人：孔丹
客户服务电话：95558
公司网址：bank.ecitic.com

（6）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
电话：010-58351666
传真：010-83914283
联系人：董云巍、吴海鹏
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（7）深圳发展银行股份有限公司
住所：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：法兰克.纽曼（Frank N.Newman）
联系电话：0755-82088888
传真电话：0755-82080714
联系人：张青
客户服务电话：95501
公司网址：www.sdb.com.cn

（8）上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：汤嘉惠、虞谷云
客户服务电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（9）温州银行股份有限公司
住所：温州市车站大道华海广场1号楼
办公地址：温州市车站大道196号
法定代表人：邢增福
联系电话：0577-88990082
传真：0577-88995217
联系人：林波
客户服务电话：0577-96699
公司网址：www.wzbank.cn

（10）国联证券股份有限公司
住所：无锡市县前东街168号
办公地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣
客户服务电话：0510-82588168
公司网址：www.glsc.com.cn

（11）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
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务电话：95579或4008-888-999
公司网址：www.95579.com

（12）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：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸、李笑鸣
客户服务电话：95553
公司网址：www.htsec.com

（13）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：顾伟国
电话：010-66568047
传真：010-66568536
联系人：李洋
客户服务电话：4008-888-888
公司网址：www.chinastock.com.cn

（14）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：北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：400-888-8108
开放式基金业务传真：010-65182261
公司网址：www.csc108.com

（15）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：祝幼一
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：芮敏祺
客户服务电话：400-888-8666
公司网址：www.gtja.com

（16）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
电话：021-54033888
联系人：李清怡
客户服务电话：021-962505
公司网址：www.sw2000.com.cn

（17）广发证券股份有限公司
住所：广东广州天河北路大都会广场43楼
办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人：王志伟
电话：020-87555888
传真：020-87555305
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

（18）湘财证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634518
传真：021-68865680
联系人：鲁雁先
客户服务电话：400-888-1551
公司网址：www.xcsc.com

（19）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：上海浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21楼
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565783
联系人：谢高得
客户服务电话：400-8888-123
公司网址：www.xyzq.com.cn

（20）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777
传真：025-84579763
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（21）东吴证券股份有限公司
住所：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人：吴永敏
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
客户服务电话：0512-33396288
公司网址：www.dwzq.com.cn

（22）中信金通证券有限责任公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层
法定代表人：刘军
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
联系人：俞会亮
客户服务电话：96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

（23）金元证券股份有限公司
住所：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
电话：0755-83025666
传真：0755-83025625
联系人：金春
客户服务电话：4008-888-228
公司网址：www.jyzq.com.cn

（24）东海证券有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：李涛
客户服务电话：400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

（25）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
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn

（26）中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层
法定代表人：唐新宇
电话：021-68604866
传真：021-50372474
联系人：张静
客户服务电话：400-620-8888
公司网址：www.bocichina.com

（27）平安证券有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
法定代表人：杨宇翔
电话：4008866338
传真：0755-82400862
联系人：周璐
客户服务电话：400-881-6168
公司网址：www.pingan.com

（28）华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
联系人：庞晓芸
客户服务电话：95513
公司网址：www.lhzq.com

（29）西南证券股份有限公司
住所：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A座22-25层
法定代表人：王珠林
电话：023-63786922
传真：023-63786215
联系人：陈诚
客户服务电话：400-8096-096
公司网址：www.swsc.com.cn

（30）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34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
法定代表人：牛冠兴
电话：021-68801217@ 传真：021-68801210
联系人：张勤
客户服务电话：4008-001-001
公司网址：www.essence.com.cn

（31）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：400-888-8788或10108998
公司网址：www.ebscn.com

（32）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16层至26层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133302
联系人：齐晓燕
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（33）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经七路86号23层经纪业务总部
法定代表人：李玮
电话：0531-68889115
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
客户服务电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

（34）第一创业证券有限责任公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：魏颖
电话：0755-25832852
客户服务电话：0755-25832583
公司网址：www.firstcapital.com.cn

（35）万联证券有限责任公司
住所：广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人：张建军
电话：020-37865070
联系人：罗创斌
开放式基金咨询电话：400-8888-133
开放式基金接收传真：020-22373718-1013
公司网址：www.wlzq.com.cn

（36）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：010-88085240
客户服务电话：4008-000-562
公司网址：www.hysec.com

（37）中国建银投资证券有限责任公司
住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人：杨小阳
电话：0755-82026511
传真：075582026539
联系人：杨瑞芳
客户服务电话：400-600-8008
公司网址：www.cjis.cn

（38）渤海证券股份有限公司
住所：天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客户服务电话：400-651-5988
公司网址：www.bhzq.com

（39）国金证券股份有限公司?
住所：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：冉云
联系人：金喆
客户服务电话：400-660-0109
公司网址：www.gjzq.com.cn

（40）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客户服务电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

（41）方正证券有限责任公司
住所：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
联系电话：0731-85832343
传真：0731-85832214
客户服务电话：95571
公司网址：www.foundersc.com

（42）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：潘锴
电话：0431-85096709
客户服务电话：4006000686
公司网址：www.nesc.cn

（43）东兴证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：崔海涛
联系人：黄英
客户服务电话：4008-888-993
公司网址：www.dxzq.net

（44）天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
电话：010-66045446
传真：010-66045500
联系人：潘鸿
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中海基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人：陈浩鸣
总经理：陈浩鸣
成立日期：2004年3月18日
电话：021-38429808
传真：021-68419328
联系人：曹伟

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：江苏公证天业会计师事务所有限公司（原江苏公证会计师事务所）
住所：无锡市新区开发区旺庄路生活区
办公地址：无锡市梁溪路28号
法定代表人：张彩斌
电话：0510-85888988 85887801
传真：0510-85885275
经办注册会计师：夏正曙、钱云霞

六、基金的募集

（一）募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关法律法规，并经中国证监会　　年　　月　　日证监许可［　　］　　号文核准募集发售。

（二）基金类型及基金存续期间

1、基金类型：混合型证券投资基金
2、基金运作方式：契约型开放式
3、基金存续期间：不定期

（三）募集方式

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

（四）募集期限

自基金份额发售之日起，最长不超过3个月，具体发售时间以基金份额发售公告为准。

（五）募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及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开放式证券投资基金的其他投资者。

（六）募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金销售机构认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认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

（七）募集目标

本基金不设募集规模上限，在本基金的募集达到备案条件的前提下，基金管理人可视募集情况提前结束募集。

（八）基金份额的认购

1、基金份额初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额初始面值：本基金基金份额初始面值为1.00元人民币，按初始面值发售。

（2）认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，如下所示：

（单位：元）

认购金额(M)	认购费率
M<100万	1.20%
100万≤M<500万	0.80%
500万≤M<1000万	0.20%
M≥1000万	每笔1000元

投资者重复认购，须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

（3）认购份额的计算

本基金份额的初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

本基金认购采取金额认购方式，认购份额的计算包括认购金额和认购金额在本基金募集期间产生的利息，其中利息以注册登记机构的记录为准，保留小数点后两位。认购份额计算时采用四舍五入方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

本基金有效认购申请的认购费用及认购份额的计算统一采用外扣法，计算公式如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）。
认购费用=认购金额-净认购金额，或，认购费用=固定认购费金额。
认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额初始面值。

例：某投资者投资10，000元认购本基金，认购费率为1.20%，假定募集期产生的利息为3.00元，则可认购基金份额为：

净认购金额=10，000/（1+1.2%）=9，881.42元
认购费用=10，000-9，881.42=118.58元
认购份额=（9，881.42+3.00）/1.00=9，884.42份

即：该投资者投资10，000元认购本基金，可得到9，884.42份基金份额。

2、认购的程序

（1）认购时间安排

投资者认购本基金份额具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告。

（2）投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

（3）基金份额的认购采用金额认购方式

投资者认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资者在基金募集期内可多次认购，认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。投资者的认购申请一经受理不得撤销。

（4）认购的确认

当日（T日）在规定时间内提交的申请，投资者通常可在T+2日到网点查询认购申请的受理结果，在基金合同生效后的2个工作日内可以到网点打印交易确认书。

（5）认购金额的限制

通过本公司网站和代销机构首次认购单笔最低金额为人民币1000元，追加认购单笔最低金额为人民币1000元；通过本公司直销柜台首次认购单笔最低金额为人民币100，000元，追加认购单笔最低金额为人民币10，000元。投资者在募集期内可以多次认购基金份额。募集期间不设置投资者单个基金账户最高认购金额限制。

3、若基金合同生效，认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。认购利息折算的基金份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。认购利息折成基金份额不收取认购费、不受最低认购份额限制。

（九）募集资金的管理

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额持有人不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及《招募说明书》可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和基金资产净值

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5，000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购和赎回

（一）申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购、赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券交易市场或证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日或具体业务办理时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日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、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。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况依法调整上述原则。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。

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。

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，基金管理人或其委托的注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者应在T+2日后（包括该日）及时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。

申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

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注册登记机构及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。

（五）申购与赎回的数额限制

1、通过本公司网站和代销机构首次申购单笔最低金额为人民币1，000元，追加申购单笔最低金额为人民币1000元；通过本公司直销柜台首次申购单笔最低金额为人民币100，000元，追加申购单笔最低金额为人民币10，000元；投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

3、投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、投资者可将其全部或部分基金份额赎回，单笔最低赎回份额为100份（除非该账户在销售机构或网点托管的基金份额余额不足100份）；若某笔赎回或转换导致持有人在该销售机构或网点托管的基金份额余额少于10份，剩余部分基金份额必须一起赎回，即交易账户最低基金份额为10份。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

（六）申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担。

2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、申购费用

本基金申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

购买金额(M)	申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<500万	1.00%
500万≤M<1000万	0.30%
M≥1000万	每笔1000元

4、赎回费用

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定，赎回费率如下：

持有时间(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。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，基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和赎回费率，并另行公告。

6、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：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额，或，申购费用=固定申购费金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者投资10，000元申购本基金，申购费率为1.5%，假定申购当日基金份额净值为1.05元，则可申购基金份额为：

净申购金额=10，000/（1+1.5%）=9，852.22元
申购费用=10，000-9，852.22=147.78元
申购份额=9，852.22/1.05=9，383.07份

即：该投资者投资10，000元申购本基金，可得到9，383.07份基金份额。

2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金1万份基金份额，持有时间为6个月，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.100元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10，000×1.100=11，000元
赎回费用=11，000×0.5%=55.00元
净赎回金额=11，000-55.00=10，945元

3、本基金基金份额净值的计算：

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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，由此产生的误差计入基金财产。

4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（八）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，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，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并于调整前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可以暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作。

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算。

（3）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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益。

（4）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

（5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》在指定媒体刊登暂停申购公告。

（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续2个或2个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

（4）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个申请赎回本基金的基金份额持有人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给申请赎回本基金的基金份额持有人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过20个工作日，并在指定媒体公告。基金份额持有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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒体上刊登暂停赎回公告。

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，并依照有关规定在指定媒体上公告。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，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）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为支付基金份额持有人的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；基金份额持有人未能赎回部分，除基金份额持有人在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）如发生巨额赎回时，涉及基金转换业务的，基金管理人将基金转出部分视同基金赎回情况处理，投资者的转换申请可能被延迟或部分实现转换。

（4）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在2日内通过指定媒体公告，并向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。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续2个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并在指定媒体公告。

（十二）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指定媒体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，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体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工作日的基金份额净值。

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。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

（十三）基金的转换

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，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的且由同一基金注册登记机构办理注册登记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并公告。

（十四）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个销售机构的交易账户转入另一个销售机构的交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

（十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

（十六）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”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的情形；“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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的可持有本基金份额的投资者的条件。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。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

（十七）基金份额的冻结、解冻与质押

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的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金注册登记机构可制定并实施相应的业务规则，办理基金份额的质押业务。

九、基金的投资

（一）投资目标

在全球环境状况不断恶化、气候逐渐变暖以及我国节能减排压力日益突出的背景下，以环保为投资主题，重点关注具有环保责任和环保意识、并同时具有成长潜力的环保产业和新能源产业以及具有环保竞争优势的行业和企业，充分分享国内环保业和新能源产业发展带来的投资机会，并精选个股，结合积极地权重配置，谋求基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的30%-80%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）占基金资产的20%-70%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，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。本基金80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品（如股指期货、期权等衍生品），基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资理念

基于我国节能减排政策以及其他环保相关政策的推进发展，考虑环保产业在我国的发展前景，综合比较不同行业和公司在环保政策下面临的竞争环境和机遇，挖掘在兼具环保责任和环保意识的基础上具有成长潜力的上市公司及新能源领域的具有成长潜力的上市公司，进行主动的投资管理。

本基金对所有的A股上市公司进行行业分类，首先分成环保行业类与非环保行业类；再将非环保行业按行业的节能减排情况分为环保优势行业与环保劣势行业；最后根据环保劣势行业的环境数据综合评价，将环保劣势行业分为环保改善行业和环保潜力行业。

本基金认可的环保与新能源主题类股票包括：

（1）环保行业，包括环保设备、环保服务和资源利用等相关行业。

（2）新能源行业，包括风电、核电、光伏、智能电网、新能源汽车等相关行业。

（3）环保优势行业。环保优势行业主要集中在第三产业如金融地产、公用事业、商业旅游、信息服务、食品饮料、消费等行业。

当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级，从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述环保新能源主题的识别及认定。

（四）投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，本基金主要考虑如下因素：

宏观经济，包括国际经济和国内经济等，判断经济周期是否处于衰退、复苏、过热和滞胀阶段，通过投资时钟，确定阶段性较优资产。历史表明，复苏期股票最优，过热期商品最优，滞胀期现金最优，衰退期债券最优。

政策层面，包括宏观政策（货币和财政政策）松紧、区域经济扶持政策力度、资本市场相关政策和行业政策扶持等，不同政策发布会对不同资产类别产生不同程度影响。

市场估值，包括市场的资金供求状况、估值水平、不同类资产的预期收益率水平和相对吸引力等。

市场情绪，包括市场成交量、股票账户新增开户数、持仓账户数及其他反映投资者情绪的技术指标。

本基金将深入分析上述四方面的情况，对每一方面的情况进行打分。每一大类因素设置不同的权重，并且根据市场的变化，对各因素的权重进行相应调整。通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。

2、行业/久期配置

行业配置：本基金以环保行业配置和新能源行业配置为主，其中环保行业配置采取以行业环保水平为主要配置原则的倒金字塔环保行业配置。即环保行业作为行业配置的重点，其次是非环保行业中的环保优势行业，再次是环保劣势行业中的环保改善行业，最后则是环保潜力行业。本基金重点关注环保行业、新能源行业以及非环保行业中的环保优势行业，以突出本基金的环境主题特征。

具体由行业研究小组完成行业前景分析报告；金融工程研究小组基于行业研究小组的研究成果，并综合流通市值、成交金额等多项指标对关注的行业进行综合评分和筛选；基金经理综合动态调整不同行业间的权重配置。

久期配置：债券组合的久期配置采用自上而下的方法。通过数量模型对宏观经济周期趋势性变化进行分析预测，并结合货币政策和财政政策，分析预测债券市场收益率变化趋势。利用债券回报分析模型进行情景分析，判断不同期限债券在市场收益率变化条件下的风险收益关系，确定投资组合的久期配置。

3、股票投资

本基金80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略：

（1）以行业的环保水平、行业的环境竞争优势以及是否属于新能源领域对行业进行分类，并将环保产业、环保优势行业、环保改善行业、环保潜力行业与新能源行业的股票作为备选构建初选股票池；

（2）依据公司所属行业的环境优势评级赋予公司环境优势因子，通过中海财务评价体系和MMVA估值评价体系为评估基础，对公司的财务优势、估值优势综合评估进行量化选股，构建优选股票池；

（3）通过环境战略矩阵模型分析优选股票池中公司的环境战略，并采用中海上市公司环境评价体系对公司的环境优势进行综合评估；在此基础上，选取基本面较优，既具备环保优势，又有成长优势，能够在环保基础上实现可持续发展的上市公司来构建核心股票池；

（4）基金经理通过对核心股票池中的股票价值分析和市场环境的判断，相机选择具有估值优势的公司构建投资组合，并根据市场变化自主选择投资时机和权重，长期持有并结合适度波段操作，争取获得较高收益。

4、债券投资

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

本基金通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择遵循以下原则：

（1）相对价值原则

属性相近的单个债券，选择收益率较高的券种；在收益率相同的情况下，选择风险（久期）较低的券种。对二者都相近的券种，根据凸性，选择凸性较大的券种。

（2）流动性原则

收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种，市场表现有时差别明显。在一般情况下，避免波动性过大的券种，选择流动性较好的券种。

5、权证投资策略

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，利用Black-Scholes-Merton模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，权证投资策略主要从价值投资的角度出发，采用如下策略进行权证投资：

（1）套利投资策略

在权证和标的股票之间出现套利机会时，对权证进行套利投资。

（2）风险锁定策略

根据认沽权证和标的股票之间的价差，在投资标的股票的时候，同时投资认沽权证，锁定投资风险。

（3）股票替代策略

在价值投资的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，寻找溢价率低（甚至折价）的权证，利用权证替代股票，以期降低风险或提高潜在收益。

由于权证市场的高波动性，本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险，寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。

（4）杠杆投资策略

对以根据量化模型所选品种为标的股票的权证进行模型定价研究，利用权证的杠杆效应，以期获得超额收益。

（五）投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保；

（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。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

a、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%；

b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

c、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%；

d、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

e、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；

f、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%；

g、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%；

h、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，不得超过该基金资产净值的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%；

i、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；

j、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

k、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

l、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

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的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，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。

（六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%。

沪深300指数于2005年4月正式发布，是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。沪深300指数的运行结果显示，该指数走势强于上证综合指数和深证综合指数。沪深300指数成份股为A股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于2003年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）上公开发布。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持30%-80%的股票资产，20%-70%的债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）。从长期看，本基金股票资产平均配置比例为60%，债券资产的投资比例为40%，因此本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为60%和40%。因此，“沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金属混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

2、有利于基金资产的安全与增值。

3、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。

4、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。

（九）基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

十、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

(下转D7版)