中银证券保本1号混合型证券投资基金招募说明书

(上接B11版)

(二)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

邮政编码:100033

法定代表人:王洪章

成立日期: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:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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机构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

(一)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,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。

本基金的投资范围如下:

1.保本周期内

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制将资产配置于稳健资产与风险资产,本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产;本基金投资的风险资产为国内依法发行上市的股票、权证等权益类资产。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制对稳健资产和风险资产的投资比例进行动态调整,本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%;每个交易日日终现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

2.转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、中央银行票据、政策性金融债、金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等)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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%;应当保持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%;权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

(二)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.保本周期内

(1)本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%,债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%;

(2)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;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)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%;

(6)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7)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%;

(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%;

(9)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%;

(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%;

(11)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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%;

(12)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;

(13)基金财产参与股票发行中购,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;

(14)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(16)基金总资产不得超过基金净资产的200%;

(17)本基金持有的单只流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金持有的全部流通受限证券,其市值之和不得超过基金资产净值的15%。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;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规或监管部门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,但须提前公告,不需经基金份额持有人大会审议。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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,法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

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。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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.转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后

(1)本基金的股票资产投资比例为基金资产的0-95%;

(2)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;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)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%;

(6)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7)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%;

(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%;

(9)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%;

(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%;

(11)本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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%;

(12)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;

(13)基金财产参与股票发行中购,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;

(14)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(16)基金总资产不得超过基金净资产的200%;

(17)本基金持有的单只流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金持有的全部流通受限证券,其市值之和不得超过基金资产净值的15%。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;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规或监管部门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,但须提前公告,不需经基金份额持有人大会审议。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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,法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

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。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

(三)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账户的资金账户、证券账户等投资所需账户。

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。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或登记结算机构扣收结算费和账户维护费等费用)。

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。

(二)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。

(三)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基金财产。

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不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。

(四)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不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。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付,待托管产品启始运营后,基金管理人可向基金托管人发送划款指令,将代垫开户费从本产品托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后,基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

证券账户开户费由本基金财产承担,于证券账户开立次月初七个工作日内由基金托管人从本基金银行存款账户中直接扣收;若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收,基金托管人顺延至次月初七个工作日内进行扣收;证券账户开立后连续六个月内,因本基金银行存款余额持续不足导致证券账户开户费无法扣收的,基金管理人有义务先行支付基金托管人垫付的开户费用。

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、结算保证金、交收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以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5.若中国证监会或证券交易所、证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》规定,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(七)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。

(八)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,应及时以电话报酬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原因,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,基金管理人应根据托管协议或法律法规的规定,在规定期限内及时改正,并将纠正结果及时书面报告基金托管人。基金管理人未按照规定期限内及时改正的,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,基金管理人应报告中国证监会。

(九)基金管理人有义务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。

(十)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。

(十一)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,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、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对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。

(二)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原因,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。

(三)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

(一)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账户的资金账户、证券账户等投资所需账户。

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。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或登记结算机构扣收结算费和账户维护费等费用)。

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。

(二)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。

(三)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基金财产。

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不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。

(四)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不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。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付,待托管产品启始运营后,基金管理人可向基金托管人发送划款指令,将代垫开户费从本产品托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后,基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

证券账户开户费由本基金财产承担,于证券账户开立次月初七个工作日内由基金托管人从本基金银行存款账户中直接扣收;若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收,基金托管人顺延至次月初七个工作日内进行扣收;证券账户开立后连续六个月内,因本基金银行存款余额持续不足导致证券账户开户费无法扣收的,基金管理人有义务先行支付基金托管人垫付的开户费用。

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、结算保证金、交收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以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5.若中国证监会或证券交易所、证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》规定,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(五)债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户,持有人账户和资金结算账户,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。

(六)其他账户的开立和管理

1.在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

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。

(七)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有价凭证等的实物证券,银行存款开户证实书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的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让,按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担保管责任。

(八)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。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。

对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供合同复印件,并在复印件上加盖公章,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

(一)基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个交易日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应对当天基金资产估值、基金份额净值结果予以复核,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间,便于基金托管人复核相关报表及报告。

(八)基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

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,除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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。

本协议中因法律管辖、

八、托管协议的变更和终止

(一)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备案。

(二)托管协议终止的情形

1.《基金合同》终止;

2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或出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、破产或出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。

(上接B9版)

C.本人有效身份证件原件及复印件;

D.预留银行账户信息证明复印件;

E.填妥的经本人签字确认的《风险承受能力调查问卷-个人投资者》;

F.个人投资者开户原则上须本人亲自办理,如委托他人代办的,还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件;

G.填妥的传真委托服务协议书。

机构投资者

A.填妥的加盖公章和法定代表人签章的《开放式基金账户业务申请表-机构投资者》;

B.企业营业执照副本及其复印件(加盖公章)或有效注册登记证书副本及其复印件(加盖公章)、组织机构代码证复印件(加盖公章)、税务登记证复印件(加盖公章);

D.基金业务授权委托书(加盖公章和法定代表人签章);

E.预留印鉴;

F.法定代表人有效身份证件原件及复印件;

G.授权经办人有效身份证件原件及复印件;

H.经办人有效身份证件原件及复印件;

I.预留银行账户信息证明复印件;

J.填妥并加盖预留印鉴的《风险承受能力调查问卷-机构投资者》;

K.填妥的传真委托服务协议

(2)申请认购时须提交下列材料:

个人投资者

A.填妥的经本人签字或盖章确认的《开放式基金交易业务申请表》;

B.本人有效身份证件原件及复印件;

C.银行付款凭证/划款回单原复印件。

D.委托他人代办的,还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

机构投资者

A.填妥的《开放式基金交易业务申请表》(加盖预留印鉴);

B.经办人有效身份证件;

C.银行付款凭证/划款回单原复印件。

(3)认购资金的划拨

投资者在办理认购前应将足额认购资金划入本公司指定的下述任意一个直销专户:

1)账户名称:中银国际证券有限责任公司基金直销专户

账号:3105001364000000492

开户银行:中国建设银行

2)账户名称:中银国际证券有限责任公司基金直销专户

账号:0219003547104543

开户银行:招商银行

3)账户名称:中银国际证券有限责任公司基金直销专户

账号:455970399866

开户银行:中国银行

4.注意事项

(1)本直销柜台不受理投资者以现金方式提出的认购申请;

?(2)投资者开立基金账户的当天可申请认购,但认购的有效要以基金账户开立成功为前提;

?(3)投资者开户时须预留银行账户,该银行账户作为投资者赎回、分红、退款的结算账户,银行账户的户名应与投资者基金账户的户名一致;

?(4)投资者应在提交认购申请的当日17:00前将足额认购资金划至本公司直销专户,否则视同认购无效;

?(5)如投资者已划付认购资金,但逾期未办理开户手续,视同认购无效;

?(6)投资者T日提交的开户和认购申请,可于T+2日到本公司直销柜台查询确认结果,或通过本公司客户服务中心、本公司基金网站查询;

?(7)直销柜台办理地址:北京市西城区西单北大街110号7层(邮政编码:100033)

(二)其他销售机构办理开户和认购程序

本基金其他销售机构的认购流程详见各销售机构的业务流程规则。

四、清算与交割

本基金基金合同生效前,全部有效认购资金将被冻结在基金募集专户中,有效认购资金冻结期间的利息在基金合同生效后折成基金份额,归基金份额持有人所有,以登记机构计算的利息为准。

本基金登记机构在募集结束后对基金权益进行登记。

基金合同生效之前发生的与基金募集活动有关的费用,包括信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

五、基金的验资与基金合同的生效

基金募集期限届满,本基金具备基金备案条件的,基金管理人应当自募集期限届满之日起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,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效,基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

(上接B10版)

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证,基金管理人或基金托管人拒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。

(3)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。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,法律法规或监管部门另有规定或相关规定发生变更时,从其规定。

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

(九)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,或法律法规关于基金份额持有人大会的规定发生变化时,从其规定。本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规、监管规则的部分,如将来法律法规、监管规则修改导致相关内容被取消或变更的或法律法规、监管规则增加新的持有人大会机制的,基金管理人相应公告后,可直接对本部分内容进行修改,调整或补充,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金的保本

(一)保本周期

本基金以每三年为一个保本周期。本基金的第一个保本周期自基金合同生效日起至三个公历年度后的对应日止,如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。保本周期届满时,若符合保本基金存续条件,本基金转入下一保本周期;基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则,确定下一个保本周期的起始时间;第一个保本周期之后各保本周期自基金公告的保本周期起始之日起至三个公历年后对应日止,若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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,法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

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。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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.转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制将资产配置于稳健资产与风险资产,本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等)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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制对稳健资产和风险资产的投资比例进行动态调整,本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%;每个交易日日终现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

2.转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、中央银行票据、政策性金融债、金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等)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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%;应当保持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%;权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

(四)转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"之后的投资限制

(1)组合限制

1)本基金的股票资产投资比例为基金资产的0-95%;

2)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;

3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

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

5)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%;

6)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%;

7)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%;

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%;

9)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%;

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%;

11)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%;

12)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;

13)基金财产参与股票发行中购,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;

14)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

15)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

16)基金总资产不得超过基金净资产的200%;

17)本基金持有的单只流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金持有的全部流通受限证券,其市值之和不得超过基金资产净值的15%。基金