

## 汉兴证券投资基金基金契约正文

### 一、前言

(一)订立汉兴证券投资基金契约(以下简称“本基金契约”)的目的、依据和原则:

1、订立本基金契约的目的是为了保护基金投资人的合法权益,明确基金契约当事人的权利与义务,规范基金运作。

2、本基金契约是根据《证券投资基金管理暂行办法》(以下简称《暂行办法》)及有关法规和中国证监会的有关规定而订立。

3、本基金契约的订立遵循诚实信用、平等自愿、真实合法、充分保护投资者合法权益的原则。

(二)本基金由海通证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、江苏证券有限责任公司、福建国际信托投资公司、山东省国际信托投资公司和富国基金管理有限公司六方发起人依照《暂行办法》及有关法规并获中国证监会批准发起设立。

中国证监会对本基金设立的批准,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。

基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不对基金的最低收益作出保证。

(三)本基金发起人、基金管理人和基金托管人的契约关系受《暂行办法》及本基金契约的约束,享受相应权利,承担相应义务。

(四)基金投资人自取得依本基金契约所发行的基金单位即成为基金持有人,其持有基金单位的行为本身即表明其对基金契约的承认和接受,并按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定享有应有的权利,承担应有的义务。

### 二、基金契约当事人

#### (一)基金发起人

##### 1、海通证券有限公司

住所:上海市唐山路 218 号

法定代表人:王开国

注册资本:10 亿元人民币

成立时间:1994 年 1 月 7 日

批准设立机关:中国人民银行

批准设立文号:J15312907021

组织形式:有限责任公司

存续期间:持续经营

经营范围:代理证券发行、还本付息业务;自营、代理证券买卖业务;办理证券的代保管和鉴证业务;接受委托代收证券本息和红利;办理证券的登记、过户和清算;证券投资咨询和投资基金业务;经中国人民银行批准经营的其他

业务。

2、申银万国证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区南京东路 99 号

法定代表人：朱 恒

注册资本：13.2 亿元人民币

成立时间：1996 年 9 月 16 日

批准设立机关：中国人民银行

批准设立文号：J11312901022

组织形式：股份有限公司

企业法人营业执照号：150437600

存续期间：持续经营

经营范围：发行和代理发行各种有价证券；自营和代理买卖各种有价证券；证券的代保管、鉴证和过户；代理还本付息、分红、派息等权益分派；证券抵押融资；基金和资产管理；企业重组；收购与兼并；投资咨询；财务顾问；外币证券。

3、江苏证券有限责任公司

住所：江苏省南京市管家桥 87 号

法定代表人：张开辉

注册资本：4.04 亿元人民币

成立时间：1992 年 12 月 31 日

批准设立机关：中国人民银行

批准设立文号：银金管字第 08-0371 号

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：发行和代理发行各种有价证券业务；自营和代理买卖各种有价证券业务；有价证券的代保管、鉴证和过户业务；代理还本付息、分红派息等权益分派业务；证券抵押融资业务；基金和资产管理业务；企业重组、收购与兼并业务；投资咨询、财务顾问业务；经中国人民银行批准的其他证券业务。

4、福建国际信托投资公司

住所：福建省福州市五四路国际大厦 22 层

法定代表人：陈桂宗

注册资本：10 亿元人民币

成立时间：1983 年 11 月 23 日

批准设立机关：中国人民银行、国家外汇管理局

批准设立文号：K11913900137

组织形式：国有独资

存续期间：持续经营

经营范围：信托存贷款、投资业务；委托存贷款、投资业务；有价证券业务；金融租赁业务；代理财产保管与处理业务；代理收付业务；经济担保和信用见证业务；经济咨询业务；中国人民银行批准经营的其它金融业务。

5、山东省国际信托投资公司

住所：山东省济南市解放路 166 号

法定代表人：赵奎

注册资本：11 亿元人民币

成立时间：1986年12月16日

批准设立机关：中国人民银行

批准设立文号：K12214500098

组织形式：国有独资

存续期间：持续经营

经营范围：信托存贷款、投资业务；委托存贷款、投资业务；房地产投资业务；有价证券业务；金融租赁业务；代理财产保管与处理业务；代理收付业务；经济担保和信用见证业务；经济咨询业务；中国人民银行批准经营的其他金融业务。

#### 6、富国基金管理有限公司

住所：北京市建国门外大街一号国贸中心西楼六层

法定代表人：虞志皓

注册资本：1亿元人民币

成立时间：1999年4月13日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基字[1999]11号

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务；发起设立基金。

### (二)基金管理人

名称：富国基金管理有限公司

住所：北京市建国门外大街一号国贸中心西楼六层

法定代表人：虞志皓

成立时间：1999年4月13日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监基字[1999]11号

组织形式：有限责任公司

实收资本：1亿元人民币

经营范围：基金管理业务；发起设立基金。

存续期间：持续经营

### (三)基金托管人

名称：交通银行

住所：上海市仙霞路18号

法定代表人：王明权

成立时间：1987年4月1日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发（1986）字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文

组织形式：股份制商业银行

实收资本：120亿元人民币

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄存款；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款、汇款、外汇投资；在境内外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币承兑和贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇、外币有价证券；境内外外汇借款；外币及外币票据兑换；保管业务；征信调查和资讯服务。

存续期间：持续经营

### 三、基金契约基本情况

- (一)基金名称：汉兴证券投资基金。  
 (二)基金类型：契约型封闭式。  
 (三)基金单位发行总额：30 亿个基金单位。  
 (四)基金单位每份面值为人民币 1 元，发行费用 0.01 元，发行价格 1.01 元。

(五)存续期限：15 年(自 1999 年月日到年月日)。

根据《暂行办法》规定，经基金持有人大会和基金托管人同意，可向中国证监会申请扩募或者续期。

### 四、基金单位的发行

除本基金发起人必须认购的份额外，任何与基金单位发行有关的当事人不得预留和提前发售基金单位。

(一)基金单位的发行时间、发行方式、发行对象

- 1、发行时间：1999 年 月 日
- 2、发行方式：上网定价方式
- 3、发行对象：中华人民共和国境内自然人(法律法规、规定禁止者除外)。

(二)基金单位每份发行价格

本基金单位的发行价格为 1.01 元，其中面值为 1 元，发行费用为 0.01 元。

(三)基金发起人认购的份额

基金发起人认购的份额为 3000 万份，占基金单位总份额的 1%：

基金发起人	认购份额（万份）	占基金总份额比例
海通证券有限公司	500	0.166%
申银万国证券股份有限公司	500	0.166%
江苏证券有限责任公司	500	0.166%
福建国际信托投资公司	500	0.166%
山东省国际信托投资公司	500	0.166%
富国基金管理有限公司	500	0.166%

本基金发起人认购的基金单位，自基金成立起一年内不得转让。一年以后，在基金存续期内，发起人持有的份额不得低于认购份额的 50%。

(四)基金单位的认购限额

本基金发行认购最低数额不得低于 1000 份，超过 1000 份的必须为 1000 份的整数倍，每一帐户不设申购上限，可以重复申购，但每笔申购委托不得超过 99.9 万份基金单位。

根据中国证监会证监基字[1998]29 号文的有关规定，一个投资者直接或间接持有本基金的份额不得超过基金总份额的 3%，即 90000 万份基金单位，超过部分由交易所指定机构强行卖出，差价收入上缴国库。

(五)在募集期间,基金发起人、基金管理人不得动用基金已募集资金进行任何形式的投资。

## 五、基金的成立和交易安排

### (一)基金成立的条件

本基金发行期满时,如实际募集的资金超过 24 亿元人民币,即超过本基金批准规模的 80%,则本基金依法成立;否则,本基金不成立。

本基金成立前,投资者的认购款项只能存入商业银行,不得动用。

### (二)基金不能成立时已募集资金的处理方式

如本基金不能成立,本基金发起人将承担所有募集费用,并指示基金托管人将已募集资金加计银行活期存款利息在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。

### (三)基金成立后的交易安排

本基金设立以后,将根据《暂行办法》的有关规定申请在上海证券交易所上市,拟上市时间为 1999 年 月 日。

## 六、基金的托管

基于《暂行办法》、本基金契约和其他有关规定,基金管理人与基金托管人之间就基金资产的具体托管、基金持有人的名册登记、基金资产的管理和运作及其相关事宜涉及到的权利义务订立《汉兴证券投资基金托管协议》,以明确托管人和管理人的权利、义务及职责,确保基金资产的安全,保护基金持有人的合法权益。

## 七、基金的投资目标、投资范围、投资决策、投资组合和投资限制

### (一)投资目标

本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

本基金为均衡型证券投资基金,兼顾资本利得和红利以及利息收入。即在投资于成长型上市公司的同时,兼顾收益型上市公司和债券的投资,从而使投资者在承受相对较小风险的情况下,有可能获得较高的资本利得和稳定的投资收益。

### (二)投资范围

本基金只投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

### (三)投资决策

#### 1、决策依据

管理人依照国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定,根据宏观经济

环境决定投资策略；根据货币政策的变化和利率的走势决定国债在投资组合中的比例；根据对行业和地区经济发展状况的深入研究决定股票投资重点；根据对上市公司的调查研究确定具体的股票投资组合；根据证券市场走势，进行资产组合的调整。

## 2、决策程序

### (1) 决策机构

投资决策委员会是公司的非常设机构，由公司总经理、主管副总经理和相关部门的人员组成，投资委员会定期召开会议，在紧急情况下可召开临时会议。主要负责确定股票投资和债券投资的比例，确定资产分散程度和多项投资的比重，监督证券投资业务总体状况。在风险控制委员会的监督下，采取防范和控制风险措施，保障基金资产的安全。

### (2) 决策程序

本基金的投资决策程序如下：

(1) 由基金管理部经理牵头，基金经理会同研究策划部一起，就研究策划部提出的各类研究报告作进一步的分析、论证（包括宏观经济研究、行业分析、上市公司研究、市场分析），从而得出基金投资有关各项要素的初步结果及总体投资计划书，包括证券市场的走势预期、各行业的发展方向及前景、基金拟投资的证券品种的基本面情况等。所有的论证必须留有书面依据。

(2) 基金经理在上述论证成果的基础上，拟订所管理基金的投资计划、投资策略和投资组合方案。投资策略决定基金中每种资产的分布比例及股票投资的行业分布，并提供这些分布的依据、论证；投资组合方案则将投资策略细化至具体的投资品种和操作方案，必需对投资品种（尤其是重仓品种）的选择及投资数量作合理的详细论述。操作方案确定重仓投资品种的买卖区间和买卖时段，并对其可行性进行论证。基金管理部经理审核、批复基金经理提交的投资策略和投资组合方案。

(3) 基金经理向投资决策委员会提交审核后的投资策略和投资组合方案。决策委员会对其准确性和可操作性进行分析、论证，并据此达成投资决策纪要。

(4) 基金经理根据决策纪要制订最终的投资策略和投资组合方案，然后据此下达投资指令，经基金管理部经理批准，由集中交易室执行。

(5) 反馈机制：反馈机制分为两个层次，一是集中交易室的层次，二是基金经理的层次。集中交易室同时向基金管理部经理和基金经理负责，当投资目标出现操作性问题和市场异动时需及时向基金管理部经理和基金经理反馈情况。基金经理对反馈信息分析后决定是否调整投资指令、投资策略和投资组合方案。如果认为需要进行调整，则需视具体情况分别向基金管理部经理或投资决策委员会提出反馈意见。当基金经理通过市场观察发现原先对总体或单个投资品种的判断可能有误时，也需立即视具体情况分别向基金管理部经理或投资决策委员会反馈。反馈意见中需包含调整的建议及具体理由。基金管理部经理或决策委员会接到反馈意见后进行论证、批复，基金经理根据批复下达新的投资指令。

(6) 基金管理部与研究策划部的协调、配合：基金经理拟订投资策略和投资组合方案的原始依据均来自于研究策划部提供的各类研究成果，因此研究对基金管理的支持极为重要。基金经理对研究工作的需求要及时与研究策划部沟通，以得到研究策划部的充分配合。例如宏观经济政策的专题报告、重点投资行业的深层次多角度分析和一些上市公司的跟踪调研等等。两个部门间的具体

协调、配合工作由基金管理部经理和研究策划部经理负责。

(7) 基金管理部对重仓投资品种必须有一套完善的、行之有效的管理办法。基金经理要带领基金经理助理对拟投资和已投资的重点行业、重点品种作反复、连续的跟踪研究及论证，以保证完成基金的投资目标，尽量减低投资风险，保障基金受益人的利益。

(8) 当投资组合方案执行完毕或因调整而终止执行后，基金管理部对整个投资过程进行总结。内容包括投资组合的成效检验、论证方法的检讨和改进、重点行业和重点品种的跟踪调研计划等等。总结报告上交投资决策委员会保存。

### (3) 执行监督

风险控制委员会根据市场变化情况对基金投资组合进行风险评估，并根据风险控制的要求制定风险防范措施。监察稽核部对投资组合的执行过程进行日常监督。投资组合方案实施完毕后，基金管理部负责向投资决策委员会提出总结报告，经签署后存档。

### (四) 投资组合：

1、本基金的投资组合符合以下规定：

(1) 本基金资产总值 80%以上投资于股票、债券市场，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

(2) 持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%，本基金及由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和不超过该证券的 10%；

(3) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

### 2、本基金投资组合的原则

本基金的投资组合将根据市场的变化和风险程度，严格遵循稳健经营、理性投资的投资风格，综合考虑宏观经济、行业、企业和证券市场因素来决定，本着分散性、安全性、收益性的原则调整投资组合中的证券构成，高度重视基金资产安全，最大程度地规避投资风险，谋求基金的长期稳定收益。

(1) 稳健原则，通过分散投资，力求有效地规避风险，确保基金资产的安全。

(2) 本基金为均衡型证券投资基金。本基金将股票投资的 50% 投资于有良好的成长性上市公司，50% 投资于业绩稳定的收益型的上市公司。设立均衡型的目的是从风险和收益的角度来考虑的。由于本基金有按照证券投资基金管理办法等有关法规将资产净值的 20% 投资于国债，将股票投资的 50% 投资于业绩稳定的收益型的股票，从总体上来说本基金承担的风险较为适中，同时本基金将股票投资的 50% 投资于有良好成长性的上市公司，正是在基金承担总体风险适中的情况下，追求基金资产净值的最大化。

本基金所投资的具有良好成长性上市公司具有以下主要特点：

① 所处朝阳行业，行业发展前景良好，如通讯、电子、网络、生物工程等高新技术行业以及环保、传媒业等新兴行业；

② 企业科研开发力量较强，每年的科研开发的投入量占业务收入的比重较大；

③ 公司主营产品处于成长期，产品竞争力强，市场潜力较大，市场占有率增长较快。

④ 公司股本结构合理，流通股本适中，股本扩张能力较强，资本运作能力较强。

⑤ 公司管理层具有良好的素质，企业管理水平较高，具有现代企业制度和良好的企业经营机制。

⑥ 企业财务状况良好，收入和利润的增长较为持续稳定。

本基金所投资收益型上市公司具有以下主要特点：

① 所处行业发展稳定，国家产业政策的扶持力度较大；

② 公司规模较大，工艺装备水平居国内或国际先进水平，公司在行业中占有重要地位；

③ 公司主营产品处于成熟期，产品适销对路，竞争力较强，市场占有率较高；

④ 公司领导班子强，企业管理水平较高，财务行为规范。

⑤ 公司财务状况良好，资产负债较低，净资产收益率较高且较为稳定，现金流较稳定充裕，公司分红派现能力较强且具有较好的分红派现的历史；

⑥ 公司总股本和流通股本相对较大，二级市场流通性较好，市盈率较低，股价相对比较稳定。

(3) 在防范风险的前提下，本基金将根据市场环境和变化，灵活选择一定比例的短期投资，以期获取较高的投资收益，力求基金净值或收益的最大化。

(4) 本基金将部分投资债券，获取稳定的收益，调节投资股票可能带来的收益波动，使基金的收益表现更加稳定。

(5) 在严格遵守《暂行办法》、基金契约等有关规定的情况下，基金管理人将根据具体情况，适时调整投资组合，提高投资组合的回报率。

#### (五) 投资限制

本基金禁止从事下列行为

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 3、将本基金资产进行房地产投资；
- 4、从事可能使本基金资产承担无限责任的投资；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 7、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 8、进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金持有人的利益；
- 9、配合管理人的发起人、本基金的发起人及其他任何机构的证券投资业务；
- 10、故意维持和抬高管理人的发起人、本基金的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；
- 11、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

## 八、基金发起人的权利与义务

(一) 基金发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》《〈证券投资基金管理暂行办法〉实施细则》以及中国证监会的有关规定享有以下权利：

- 1、 申请设立基金；

- 2、按基金发起人协议书的约定认购基金单位；
- 3、出席或委派代表出席基金持有人大会；
- 4、取得基金收益；
- 5、依法转让基金单位；
- 6、监督基金经营情况，取得基金业务及财务状况的资料；
- 7、参与基金清算，取得基金清算后的剩余资产；
- 8、法律法规认可的其他权利。

(二)基金发起人须履行下列义务：

- 1、公告招募说明书；
- 2、在基金设立和存续期内必须持有符合规定比例的基金单位；
- 3、遵守基金契约；
- 4、承担基金亏损或终止时的有限责任；
- 5、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；
- 6、基金不能成立时及时退还募集资金本息和按比例承担费用；
- 7、法律、法规规定的其他义务。

## 九、基金管理人的权利与义务

(一)基金管理人的权利

- 1、依法运用基金资产；
- 2、监督基金托管人忠实履行基金的托管义务；
- 3、依本契约规定获取基金管理报酬；
- 4、依照有关规定，代表基金行使股东权利；
- 5、《暂行办法》以及有关法规规定的其他权利。

(二)基金管理人的义务

1、自成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则，由高素质的专业人士对基金资产进行专业化管理；

2、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资产；

3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理与人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

4、除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不得为自己、其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

5、接受基金托管人的监督，进行基金资产运作，除法律、行政法规、本基金契约及中国证监会规定的情形外，不得委托第三人进行基金资产运作；

6、按照有关法律、法规及公认的会计原则和管理机关的规定，计算基金的资产净值及每一基金单位资产净值；

7、严格按照《暂行办法》、《证券投资基金信息披露指引》、基金契约及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

8、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、意向、资料信息等；除《暂行办法》及其他有关法规规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不向他人泄露；

- 9、及时、足额地向基金持有人分配基金收益；
- 10、不谋求对上市公司的控股、不直接参与上市公司的管理；
- 11、保存基金所有的会计帐册、记录 15 年以上；
- 12、认为基金托管人有违反法律、行政法规、本基金契约及中国证监会的有关规定的行为，及时报告中国证监会和中国人民银行；
- 13、基金终止后，参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、处理和分配；
- 14、基金管理人面临被解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时通知中国证监会和基金托管人；
- 15、承担因过错导致的基金资产的损失，且不因管理人退任而解除责任；
- 16、向基金托管人追偿因托管人故意或过失而造成基金资产的损失；
- 17、有关法律法规规定的其他义务。

## 十、基金托管人的权利与义务

### (一)基金托管人的权利

- 1、享有对基金资产运用的监督权，有权拒绝接受基金管理人不符合有关法律、法规及本基金契约规定的投资决策或经营行为；
- 2、根据本基金契约的规定收取托管费用；
- 3、出席持有人大会，监督大会各项议程及决议的产生；
- 4、监督管理人履行其职责并监督其投资管理活动符合法规及本基金契约的规定。

### (二)基金托管人的义务

- 1、以诚实信用、勤勉尽责为原则，安全保管基金的所有资产；
- 2、设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理与人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证所托管的基金资产和基金托管人资产以及不同的基金资产相互独立，对不同的基金分别设置帐户、独立核算、分帐管理，保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册管理等方面相互独立；
- 4、除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与该基金有关的重大合同、契约，以及与该基金有关的凭证，包括有价证券、物权、股权、保险凭证等；
- 6、以基金名义开设独立的证券帐户、银行帐户等基金资产帐户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；
- 7、监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资行为违法、违规时，予以警告并及时向中国证监会报告；
- 8、保守基金商业机密，除《暂行办法》及其他有关法规规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不向他人泄露；
- 9、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
- 10、按规定出具基金业绩和基金托管情况报告，并向中国证监会和中国人

民银行报告；

- 11、建立并保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；
- 12、按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；
- 13、依据基金管理人的有关指令或有关规定向基金持有人分配基金收益；
- 14、基金终止后，参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、处理和分配；
- 15、基金托管人面临被解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时通知中国证监会、中国人民银行和基金管理人；
- 16、承担因过错导致的基金资产的损失，且不因托管人退任而解除责任；
- 17、为基金向基金管理人追偿由于管理人故意或过失而造成的基金资产损失；
- 18、法律、法规规定的其他义务。

## 十一、基金持有人的权利与义务

(一)基金持有人依据国家有关法规及本基金契约的规定享有以下权利：

- 1、出席或委派代表出席基金持有人大会；
- 2、取得基金收益；
- 3、监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料；
- 4、转让基金单位；
- 5、取得基金清盘后的剩余财产；
- 6、本基金契约规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

(二)基金持有人履行下列义务：

- 1、遵守基金契约的各项规定；
- 2、交纳基金认购款项及规定的费用；
- 3、承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；
- 5、本基金契约规定的其他义务。

## 十二、基金持有人大会

(一)召开事由

下列情形之一发生时，应当召开基金持有人大会：

- 1、修订本契约；如本契约的修订事项对基金持有人的利益无重大影响，并经主管机构同意的不在此限；
- 2、提前终止基金；
- 3、更换基金管理人；
- 4、更换基金托管人；
- 5、延长基金期限；
- 6、变更基金类型；
- 7、基金扩募；

8、中国证监会规定的其他情形。

前款事项，经基金持有人大会作出决议后，报中国证监会批准。

#### (二)召集方式

1、当应由基金持有人大会决议的事项发生时，由基金管理人召集基金持有人大会；

2、在变更基金管理人或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集基金持有人大会；

3、因法规和中国证监会的规定基金管理人和基金托管人均无法行使召集权的情况下，由全体发起人共同协商确定一家发起人负责召集基金持有人大会。

#### (三)通知

基金持有人大会召开前 10 天，召集人必须在《中国证券报》、《上海证券报》等中国证监会指定的报刊上公告，基金持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开时间、地点；
- 2、会议拟审议的主要事项；
- 3、权利登记日；
- 4、投票代理委托书送达时间与地点；
- 5、会务常设联系人姓名、电话。

#### (四)出席方式

基金持有人大会可以现场开会方式，也可以在事先征得中国证监会的批准的前提下以书面开会的方式进行。

#### (五)议事内容与程序

1、议事内容：本条第一款所述的关系基金持有人利益的重大事项；

2、议事程序：在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会批准后公告；

在书面开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议，报经中国证监会批准后公告；

#### (六)表决

1、基金持有人所持每一基金单位有一票表决权；

2、基金持有人大会决议必须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上通过，但更换基金管理人或托管人应由持有半数以上基金单位总额的基金持有人通过；

3、基金持有人大会决议对全体基金持有人、基金管理人和基金托管人具有相同约束力。

#### (七)公告

基金持有人大会决议报中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

### 十三、基金托管人、基金管理人更换的条件和程序

(一)有下列情形之一者，经中国证监会和中国人民银行批准，基金托管人必须退任：

- 1、基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；

2、基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；  
3、代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金托管人退任的；  
4、中国人民银行充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

(二) 有下列情形之一的，经中国证监会批准，基金管理人必须退任：

1、基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；  
2、基金托管人充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益的；  
3、代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金管理人退任的；  
4、中国证监会充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理托管职责的。

(三) 基金管理人更换程序

1、提名：由基金托管人提名新的基金管理人；  
2、决议：基金持有人大会对新提名的基金管理人形成决议；  
3、批准：新基金管理人报中国证监会审查批准；  
4、退任：原基金管理人经中国证监会批准退任；  
5、公告：基金管理人更换后，按照法律、行政法规、本基金契约以及中国证监会的有关规定进行公告。

(四) 基金托管人更换程序

1、提名：由基金管理人提名新的基金托管人；  
2、决议：基金持有人大会对新提名的基金托管人形成决议；  
3、批准：新基金托管人报中国证监会和中国人民银行审查批准；  
4、退任：原任基金托管人经中国证监会和中国人民银行批准退任；  
5、公告：基金托管人更换后，按照法律、行政法规、本基金契约以及中国证监会的有关规定进行公告。

## 十四、基金资产

(一) 基金资产总值

基金资产总值包括基金购买各类证券价值、银行存款本息以及其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值等于基金资产总值减去基金托管人的托管费、基金管理人的报酬等按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

(三) 基金资产帐户

本基金资产以“汉兴证券投资基金专户”名义由交通银行开立基金专用银行存款帐户及证券帐户，本基金专用帐户应独立于基金管理人及基金托管人的自有资产的帐户以及其他基金资产帐户。

(四) 基金资产的处分

基金资产应独立于管理人和托管人的资产，并由托管人保管，基金管理人、基金托管人就其自有财产承担所负债务，其债权人不得对本基金资产请求冻结、扣押或其他权利。

除法律、行政法规、本基金契约及中国证监会另有规定外，不得以其他任何事由处分基金资产。

## 十五、基金资产估值

### (一) 估值目的

基金资产估值的目的是及时反映基金的投资状况，客观、准确地反映基金资产的保值、增值情况，维护投资者利益，增加基金运营的可监督性。

### (二) 估值日

基金管理人于基金成立之日起每日对基金资产进行估值。

### (三) 估值方法

基金资产的估值，按国家有关法规、主管机关的有关规定和一般公认会计准则计算。

- 1、上市证券的价格以最近一日平均价为准；
- 2、未上市的股票以其成本价计算，未上市债券价值等于该债券的发行价加至计算日止应收利息；
- 3、基金的银行存款本息等于存款本金加至计算日止应收利息；
- 4、其他投资所形成的价值为投资成本加上相应的增值部分；
- 5、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定资产价值时，基金管理人依照国家有关规定办理。

### (四) 估值对象

基金所拥有的股票、国债和银行存款本息等。

### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报告给基金托管人，基金托管人按基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

### (六) 估值暂停的情形

因不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时，将暂停基金资产的估值。上述情形包括：与本基金有关的证券交易非因公众假日而停止，或证券交易受限制或暂停、通常使用的通信中断或非基金管理人所能控制的其他事由发生等。

## 十六、基金的费用与税收

### (一) 基金费用种类

- 1、基金管理人的报酬
- 2、基金托管人的托管费
- 3、基金上市费用
- 4、证券交易费用
- 5、基金信息披露费用
- 6、基金持有人会议费用
- 7、与基金相关的会计师费用、律师费用
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用

基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

## (二) 基金管理费用计提标准及方法

### 1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬由两部分组成，一部分是基金管理费，以基金资产净值的 1.5% 年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益高于同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上，且当年基金资产净值增长率高于同期证券市场平均收益率时，按一定比例计提。具体计算方法如下：

#### (1) 基金管理费

基金管理人的管理费每日计算，按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提，基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超出部分不计提管理费。计算方法为：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费；

E 为前一日的基金资产净值（扣除基金持有现金比例超过 20% 部分的资产净值）

#### (2) 业绩报酬

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在满足以下几个基本条件下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

- ① 基金年平均单位资产净值不能低于面值；
- ② 基金可分配净率超过同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上；
- ③ 基金资产净值增长率超过证券平均收益率；
- ④ 基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在满足以上条件的情况下，基金业绩报酬计算为：

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后期初资产净值} \times \text{MIN}[M, N] \times 5\%$$

其中，M = 基金可分配净收益率 - 1.2 × 同期银行一年定期储蓄存款利率（如果年内利率发生变动，则按时间段进行加权平均调整）；

N = 基金资产净值增长率 - 证券市场平均收益率；

MIN[M, N] 为 M, N 中较小者；

基金可分配收益率 = 当年可分配净收益 / 调整后年初资产净值；

基金资产净值增长率 = (年末基金资产净值 - 调整后年初基金资产净值) / 调整后年初基金资产净值；

证券市场平均收益率 = [ (当年深综指涨跌幅 × 深市平均总市值 + 当年沪综指涨跌幅 × 沪市平均总市值) / (深市平均总市值 + 沪市平均总市值) × 80% + 同期国债收益率 × 20% ]；

沪市平均总市值 = (年末沪市总市值 + 年初沪市总市值) / 2；

深市平均总市值 = (年末深市总市值 + 年初深市总市值) / 2。

### 2、基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为每日扣除基金管理人管理费和基金托管费之前的基金资产净值

## (三) 基金管理人报酬和基金托管费的复核程序、支付方式和时间

1、复核程序：基金托管人对基金管理人计提的基金管理费和托管人托管费，根据本托管协议和基金契约的有关规定进行复核，核对无误后通知

基金管理人。

2、支付方式和时间：基金管理费逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日等，支付日期顺延；业绩报酬每个会计年度末计算，由基金托管人于次个会计年度前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人；基金托管人的托管费逐日累计至每个月最后一个工作日（遇公众假期顺延至节假日结束后的第一个工作日），按月支付。由基金托管人于次月前两个工作日从基金资产中一次性支取。

3、上述（一）中的 3-7 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

#### （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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生费用等不列入基金费用。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况降低基金管理费和基金托管费。经中国证监会批准后公告，无须召开持有人大会。

#### （六）基金税收

本基金、基金管理人和基金托管人遵守国家财务会计制度，根据财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》等国家有关规定，依法纳税。

## 十七、基金收益与分配

### （一）基金的收益构成

- 1、基金投资所得红利、股利、债券利息；
- 2、买卖证券差价；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益应为基金收益扣除按照国家有关规定和中国证监会的有关规定可以在基金收益中扣除费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、基金收益分配采取现金形式，每年至少分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 2、分配比例不低于基金净收益的 90%；
- 3、基金当年收益应先弥补上一年亏损后，才可对基金可分配收益进行分配；
- 4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、每一基金单位享有同等分配权。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中包括基金收益的范围、可分配收益、基金收益分配的对象、原则、分配日、分配方式、支付方式等内容。

（五）基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

## 十八、基金的会计与审计

### (一)基金会计政策

- 1、本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 2、本基金记帐本位币为人民币；
- 3、本基金执行国家有关的会计制度；
- 4、本基金独立建帐、独立核算；
- 5、本基金管理人保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 6、基金托管人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以书面方式确认。

### (二)基金审计

- 1、本基金聘请普华大华会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计；
- 2、会计师事务所变更经办会计师，事先征得基金管理人和托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人(托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经托管人(管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所所在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

## 十九、基金的信息披露

本基金的信息披露按《暂行办法》、《证券投资基金信息披露指引》、本基金契约及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将在《中国证券报》、《上海证券报》等中国证监会指定的刊物上公告。

### (一)定期报告

#### 1、基金的年度报告与中期报告

本基金年报在每个基金会计年度结束后 90 日内编制完成并经注册会计师审计后，于每年 3 月 31 日前公告；中期报告在每个会计年度的前 6 个月结束后的 60 日内编制完成，于每年 8 月 31 日前公告。

基金年度报告和中期报告依照中国证监会《年度报告的内容与格式》、《中期报告的内容与格式》(试行)要求的形式进行披露，并反映基金在报告期间的所有重大事项，同时一式五份分别报送中国证监会和上海证券交易所备案。

#### 2、基金资产净值公告

本基金资产净值在每周结束后 1 个工作日内公告一次。同时分别报送中国证监会和上海证券交易所备案。

在计划收益分配确定后，资产净值应扣除此部分；在基金收益未经审计之前同时公布未扣除与拟扣除计划分配收益的两项净值，收益经审计后公布已扣除计划分配收益的净值。

### 3、 基金投资组合公告

本基金的投资组合在每一季度的最后一个月结束后 15 个工作日内公告一次，应披露基金投资组合分类比例，及基金投资按市值计算的前十名股票明细。

### 4、 上市公告书

本基金获准在证券交易所上市交易时，编制基金上市公告书，在上市交易日前两个工作日内公告。

上市公告书依照中国证监会《上市公告书的内容与格式》（试行）要求编制，同时一式二份报送中国证监会和基金上市的交易所备案。

除特殊情况外，年度报告以外的定期报告毋须经会计师事务所审计。

#### （二）基金的临时报告与公告：

在本基金运作过程中发生如下可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件时，将按照《暂行办法》、实施准则第五号《证券投资基金信息披露指引》及中国证监会的有关规定及时公告。

- 1、基金持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人的董事长、总经理或基金托管部的总经理变动；
- 4、基金管理人的董事一年内变更超过 50%；
- 5、基金管理人或基金托管部主要业务人员一年内变更超过 30%；
- 6、基金管理人或基金托管人受到重大处罚；
- 7、重大诉讼、仲裁事项；
- 8、基金提前终止；
- 9、其他重大事项。

#### （三）澄清公告与说明

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的信息披露义务人知悉后必须立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报送中国证监会和上海证券交易所。

#### （四）信息披露事务管理

- 1、本基金管理人和基金托管人指定专人负责信息管理工作。
- 2、基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向基金管理人出具书面文件。
- 3、上市公告书、年度报告、中期报告在编制完成后，须放置于基金管理人所在地、基金托管人所在地、上海证券交易所、有关销售机构及其网点，供公共查阅。

## 二十、基金的扩募、续期或转型

### （一）基金的扩募或继期

本基金的类型为契约型封闭式，如果进行扩募或续期，应当具备下列条件：

- 1、本基金年收益率高于全国证券投资基金平均收益率；
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为；
- 3、基金持有人大会和基金托管人同意扩募或续期；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后，管理人可以向中国证监会申请基金的扩募或在基金存续期满时申请基金的续期，该申请由中国证监会审查批准。

#### （二）基金的转型

基金的转型是指本基金由契约型封闭式转变为契约型开放式，基金的转型应当具备下列条件：

- 1、本基金管理人（托管人）必须具备管理（托管）开放式基金所必须的人才、技术、设施等必要条件；
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为；
- 3、基金持有人大会同意基金的转型；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后，管理人可以在基金存续期内向中国证监会申请基金的转型，该申请由中国证监会审查批准。

## 二十一、基金的终止和清算

#### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金应当终止：

- 1、基金封闭期满，未被批准续期的；
- 2、基金经批准提前终止；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的。

#### （二）基金清算小组：

1、基金清算小组自基金终止之日起三个工作日内成立。基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金清算小组由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的会计师事务所及其会计师、具有证券从业资格的律师事务所及其律师以及中国证监会指定的单位和人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、处理和分配，编制清算报告，并将清算结果报中国证监会。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### （三）清算程序

- 1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金资产；
- 2、对基金资产进行清理和确认；
- 3、对基金资产进行估价；
- 4、对基金资产进行分配；
- 5、基金的剩余资产在变现后以现金的方式进行支付。

基金清算在基金终止后三个月内完成。

#### （四）清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组从基金资产中支付。

#### （五）基金剩余资产分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金持有人的基金单位的比例进行分配。

#### （六）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的重大事项将及时公告；清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

#### （七）基金清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、违约责任

（一）由于基金契约当事人的过错，造成基金契约不能履行或者不能全部履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金契约当事人双方或三方的过错，根据实际情况，由双方或三方分别承担各自应负的违约责任。

（二）当事人违反基金契约，应向对方支付违约金，如果由于违约已给对方造成的损失超过违约金的，还应进行赔偿。

在发生一方或几方违约的情况下，基金契约能继续履行的，应继续履行。

## 二十三、争议的处理

（一）本契约在履行过程中如在当事人之间出现意见分歧或争端，首先应由争执双方通过友好协商的方式解决。若无法解决，可将争执情况向主管机关报告，由主管机关进行调解。任何不接受上述协商或调解的争执方均可向人民法院提起民事诉讼。

（二）解决上述争端的准据法为中华人民共和国有关法规。

## 二十四、基金契约的效力

（一）本基金契约经七方当事人盖章以及七方法定代表人签字并经中国证监会批准后生效。基金契约的有效期限自该基金契约生效之日至该基金清算结束报中国证监会批准并公告之日。

（二）基金契约自生效之日对基金契约当事人具有同等的法律约束力。

（三）基金契约正本一式九份，除中国证监会和中国人民银行各持一份外，基金契约每一签约人各持一份。每份均具有同等的法律效力。

（四）基金契约可印制成册并存放于基金管理人和托管人办公场所，投资者可在办公时间查阅，但其效力以基金契约正本为准。

## 二十五、基金契约的修改和终止

### （一）基金契约的修改

1、基金契约的修改应当经基金契约当事人同意；

2、修改基金契约应当召开基金持有人大会，基金契约修改的内容应经基金持有人大会决议同意；

3、若有关法律、法规修订，基金契约即依修订后的法律、法规办理，并自该修订法律、法规生效之日起生效；

4、基金契约的修改应当报中国证监会核准。

## (二)基金契约的终止

1、出现下列情形之一的，应当终止基金契约：

(1) 基金封闭期满又未被批准续期的；

(2) 基金经批准提前终止；

(3) 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的。

2、基金终止后，应当对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后基金契约方能终止。

## 二十六、其它事项

基金契约如有未尽事宜，由基金契约当事人各方共同协商解决。

二十七、契约当事人盖章及法定代表人签字、  
签约地、签订日