

汉兴证券投资基金

招募说明书

重要提示

发起人保证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审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均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。

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。

单位：人民币元	发行价格	面值	发行费用	募集资金
每份基金单位	1.01	1.00	0.01	1.00
合 计	3,030,000,000	3,000,000,000	30,000,000	3,000,000,000

基金投资目标：本基金为平衡型基金，将以成长型股票和绩优型股票为投资重点，以稳健而积极的原则，谋求基金资产的长期稳定收益。

基金类型：契约型封闭式(在符合有关规定并经基金持有人大会同意、中国证监会批准后可转型为契约型开放式)；存续期为 15 年

发行总份额：30 亿份基金单位

发行对象：中华人民共和国境内自然人及我国境内依法设立的商业保险公司（法律、法规及有关规定禁止购买者除外）

发行方式：上网定价发行

发行时间：1999 年 12 月 24 日

发行协调人：海通证券有限公司

交易安排：发行成功后将申请在上海证券交易所上市

基金发起人：海通证券有限公司

江苏证券有限责任公司(现名为：华泰证券有限责任公司)

富国基金管理有限公司

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

签署日期：1999 年 12 月 18 日

汉兴证券投资基金招募说明书正文

一、绪言

本招募说明书依据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则等有关法规以及《汉兴证券投资基金基金契约》编写而成。

全体发起人已批准本招募说明书，确信其中不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

本基金单位是根据本招募说明书所载明的资料申请发行的。本基金发起人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：指汉兴证券投资基金；

本基金契约：指《汉兴证券投资基金基金契约》；

《暂行办法》：指《证券投资基金管理暂行办法》；

本招募说明书：指《汉兴证券投资基金招募说明书》；

中国证监会：指中国证券监督管理委员会；

基金发起人：指海通证券有限公司、江苏证券有限责任公司（现名为：华泰证券有限责任公司）和富国基金管理有限公司；

基金管理人：指富国基金管理有限公司；

基金托管人：指交通银行；

基金持有人：指本基金单位持有人。

三、基金设立

（一）基金设立的依据

本基金由发起人依照《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字[1999]第 38 号文批准发起设立。

（二）基金存续期间及基金类型

本基金存续期为 15 年，类型为契约型封闭式。

（三）基金发起人认购及持有情况

基金发起人认购基金单位总份额的 1%，即 3000 万份，其中：海通证券有限公司认购 1000 万份，占基金单位总份额的 0.33%；江苏证券有限责任公司认购 1000 万份，占基金单位总份额的 0.33%；富国基金管理有限公司认购 1000 万份，占基金单位总份额的 0.33%。

本基金发起人认购的基金单位，自基金上市之日起一年内不得转让。一年以后，在本基金存续期间，每个发起人持有的基金单位不得低于各自认购份额的 50%。其余 29.7 亿份基金单位面向商业保险公司配售及社会公开发行。

（四）基金契约

本基金契约是约定本基金当事人权利、义务的法律文件。基金投资者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本基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、本基金契约及有关的规定享有权利、承担义务。

基金投资者欲了解本基金持有人的权利和义务，应详细查阅《汉兴证券投资基金基金契约》。

四、本次发行有关当事人

（一）基金发起人

1、海通证券有限公司

法定代表人：王开国

注册地址：上海市唐山路 218 号

联系电话：(021) 63756385-150 63756385-212

传 真：(021) 63756458

联系人：舒芸芸 李姗

2、江苏证券有限责任公司

法定代表人：张开辉

注册地址：江苏省南京市管家桥 87 号

电 话：(025) 4523777-3802

传 真：(025) 4523777-3801

联系人：汪精周

3、富国基金管理有限公司

法定代表人：虞志皓

注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸中心商务西楼六层

电 话：(010)65055933

传 真：(010)65055977

联系人：林志松

(二) 发行协调人

海通证券有限公司

法定代表人：王开国

注册地址：上海市唐山路 218 号

联系电话：(021) 63756385-150 63756385-212

传真：(021) 63756458

联系人：舒芸芸 李姗 李鹏 花恒全

(三) 律师事务所和经办律师

金诚律师事务所

地 址：北京建国门内大街 8 号中粮广场 A 座 6 层

法定代表人：于德彬

电 话：(010)65263518

传 真：(010)65263519

联系人：戴华

经办律师：刘治海 贺宝银

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

普华大华会计师事务所

地 址：上海浦东新区沈家弄 325 号

法定代表人：汤为云

电 话：021-62709989

传 真：021-62709990

联系人：汪棣

经办注册会计师：周忠惠 王笑

五、发行安排

(一) 发行方式：上网定价发行

(二) 发行时间：1999 年 12 月 24 日，如遇重大突发事件，影响本次发行，

将在下一个工作日顺延申购。

(三) 发行对象：中华人民共和国境内自然人和我国境内依法设立的商业保险公司（法律、法规及其他有关规定禁止购买者除外）。

(四) 基金单位总份额为 30 亿份，其中：发起人认购 3000 万份；以基金单位总份额的 15% - 30%，即 4.5 - 9 亿份，供商业保险公司申请配售，每家保险公司可申请配售的数量不超过本基金单位总份额的 10%；配售后余额向社会公开发行，公开发行业数量的具体情况，详见 1999 年 12 月 22 日刊登的汉兴证券投资基金发行公告。

(五) 基金单位每份发行价格为 1.01 元，其中：面值 1.00 元，发行费用 0.01 元。

(六) 基金单位认购的最低限额为 1000 份，认购的份额必须为 1000 份的整数倍；每一帐户不设申购上限，可以重复申购，但每一笔申购委托不得超过 99.9 万份基金单位。

(七) 符合有关条件、拟配售本基金的商业保险公司，应在本招募说明书刊登当日下午 3:00 前以传真文件的方式向本基金管理人 富国基金管理有限公司提出配售申请，由富国基金管理有限公司根据申请情况进行配售。

联系人：丁国政、杨煜

联系电话：010-65055971、65055972

传真：010-65055972

六、基金成立

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，基金发起人将承担基金募集费用，已募集的资金并加计银行活期存款利息将在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。本基金成立前，投资者的认购款项存入商业银行，不得动用。

七、基金的投资

(一) 投资目标

本基金为平衡型证券投资基金，兼顾稳定收益和资本利得。即在投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。

(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。

基金的股票投资部分将主要投资于沪深两市中具有良好业绩表现的绩优型股票和具有良好成长性的成长型股票。本基金所指绩优型股票是指所处行业稳定，主营产品市场占有率较高，有持续的较高盈利水平的公司股票；成长型股票是指具有较大的业绩成长潜力和资本扩张能力、市场价值具有较大的上升空间的公司股票。

(三) 投资理念

汉兴基金是主要投资于债券、绩优型股票和成长型股票的平衡型基金。本基金将根据平衡型基金的特点，充分考虑市场的变化和 risk 程度，严格遵循稳健经营、理性投资的投资原则，在综合考虑宏观经济政策的导向及变化、国民经济各部门及各行业的变化动向、上市公司的基本状况和未来发展状况以及证券市场变化等因素的前提下，决定股票和债券的资产比例以及股票投资中成长型股票和

绩优型股票的资产比例等基本投资组合；并充分注重投资组合的流动性，同时根据市场情况的变化和管理人的判断，允许适当调整各项资产的投资比例。此种定位的依据是：

1、在风险适中的情况下谋求稳定的投资收益。经过多年的规范和发展，上市公司的整体素质有很大的提高，相当一批的上市公司已经步入成熟期，出现了一批管理比较规范、有较强的技术创新能力、主营业务突出、市场占有率较高、业绩相对稳定的绩优型公司，且这类股票的比例未来将逐步加大，此类公司有较强的盈利能力，能为投资者带来稳定的投资收益。此类股票的选择应当符合本招募说明书对此类股票的定性及定量要求，本基金管理人认为，在符合有关定性及定量标准的前提下，并经过管理人内部严密的投资目标选择、评判程序，可以为基金找到合适的投资对象，并可能为基金带来稳定的收益。基于上述判断，本基金以此类股票为重点投资对象，将股票投资部分的各 50% 投资于具有良好业绩表现的股票，同时以不低于基金资产净值的 20% 投资于具有稳定收益的国家债券，本基金将较大比例的资产投资于具有稳定收益的绩优型股票和国债，目的在于加强基金资产抵御风险的能力，使基金资产处于一个比较适当的风险水平，从而保证基金资产的安全，充分体现本基金控制风险、稳健经营、理性投资的管理思想。

2、稳健为本，不失进取。从世界范围来说，知识经济受到了广泛的关注，高科技产业的发展将突飞猛进，如网络、生物工程等。对于中国来说，科教兴国已成为国家发展的战略指导，高科技公司在上市公司的比例逐年增加，这类公司符合国家产业导向，必将得到国家政策的大力扶持，同时企业基本处于发展的初期，未来发展的规模和空间较大，具备保持业绩持续高速增长的潜力。由于高科技公司具有发展前景良好和发展不确定因素较多同时并存的特点，因此对此类股票的投资将以实证分析和预期分析相结合的方式判断，在无较多历史资料可供研究的情况下，将以预期分析为主进行判断，其结果是投资这类股票的预期收益较高，同时承担的风险也较大。选择此类公司作为投资对象之一，将股票投资的 50% 投资于此类股票，并根据市场的变化和基金经理的判断，在强势特征明显时，允许将此部分投资调整到股票投资的 70%，目的在于使投资者有可能分享公司高速增长带来的收益，体现本基金稳健为本，不失进取的管理思路。

3、保护基金资产的安全。从当前一级市场囤积大量资金的情况看，投资者的目的十分明确，保证本金的安全，获得无风险收益。因此保护基金资产的安全是本基金管理的出发点，本基金将通过选择适当投资目标进行分散组合投资，来降低投资风险，并充分注重投资组合的流动性，以降低投资组合的流动性风险，从而达到保护基金资产安全的目的。

（四）投资组合

1、投资组合的原则

（1）安全性原则。基金持有人投资基金，将资产交由管理人管理，是对基金投资方式的认同和对管理人的信任。本基金以确保基金资产安全为出发点，通过组合投资分散和控制风险；在组合投资的同时充分注重投资组合的流动性，在充分市场论证的基础上，选择流通股本相对较大或有较高流动性的股票进行投资，减少投资组合的流动性风险。

（2）稳定收益原则。债券和绩优型股票等具有稳定收益的投资品种是本基金将投资的重要组成部分，本基金投资于国家债券的部分不低于基金资产净值的 20%，投资于具有良好业绩表现的绩优型股票为股票投资的 50%。本基金以较大比例的资产投资于具有稳定收益的投资品种，通过稳健组合的方式，谋求基金资

产的长期稳定收益。

(3) 兼顾成长原则。由于中国证券市场是新兴的市场，市场本身具有高速发展的内在要求；随着产业结构调整深入，大量具有良好发展前景或经重大实质性变化，使业绩具备持续高速增长潜力的成长型公司进入证券市场。基于上述对中国证券市场和上市公司的基本判断，本基金在稳健经营的基础上，积极介入成长型公司的投资，本基金将股票投资的 50% 投资于成长型股票，并根据市场变化和管理人的判断，允许将成长型股票投资提高到股票投资的 70%，使基金持有人分享市场高速增长带来的收益。

2、本基金的投资组合遵循以下规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；

本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

本基金将股票投资的 50% 投资于成长型股票，50% 投资于绩优型股票。

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%，本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家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。

3、在遵循以上投资目标、投资范围、投资组合比例要求的基础上，基金管理人将根据具体情况的变化，保留以下对投资范围和组合进行调整的权利：

(1) 如果基金管理人根据对市场条件的判断，认为基金股票投资组合中成长型股票提供投资机会优于绩优型股票的投资机会，管理人可适当调整两部分的组合比例，但对成长型股票的投资不得高于股票投资的 70%。

(2) 如果基金管理人根据对市场条件的判断，认为市场中的其他类股票提供的投资机会优于本基金所指两类股票的投资机会，本基金可适当投资于该类股票，但比例不得高于股票投资的 10%。

4、本基金将于成立后三个月内达到规定的比例。

(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、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、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；
- 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、从事任何形式的证券承销业务；
- 10、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

(六) 投资策略

1、资产配置的原则

本基金的投资决策委员会将根据市场的变化和风险程度，严格遵循稳健经营、理性投资的投资原则，根据本基金平衡型的特点，决定股票和债券的资产比例以及股票投资中成长型股票和绩优型股票的资产比例等基本投资组合；根据对市场变化及基金经理建议的判断，当强势市场特征明显时，成长型股票最多可增

持至股票投资的 70%。

2、控制流动性风险的原则

本基金投资将充分注重投资组合的流动性，高度重视基金资产安全，成长型股票的投资，将着重于中长期平均换手率高于市场平均换手率的股票；绩优型股票的投资，将着重于流通股本大于平均流通股本的股票，除了以上一般性原则外，动态地测算投资对象的流动性风险，投资规模将充分考虑预期收益与流动性风险的平衡，确保基金净值的良好兑现能力，最大程度地规避投资风险，谋求基金的稳定收益。

3、成长型股票的选择

成长型股票的选择将基于对投资范围内的股票的业绩成长和内在价值的综合判断。所选股票应符合以下判断标准：所处行业发展前景良好，如网络、通讯、电子、生化工程、环境保护以及传媒；或所处行业虽发展前景一般，但因公司的重大实质性变化，从而使企业具备高速成长的潜力；公司在行业内具备竞争优势；企业产品开发能力较强，产品开发投入较大；公司主营业务收入增长较快，产品有较强的竞争力，市场潜力较大；公司股本结构合理，有较高的股本扩张能力和较强的流动性；公司管理层具有良好的素质，企业管理水平较高，具有明确的发展战略和良好的企业经营机制。

以上这种判断分为实证分析和预期分析两部分，实证分析主要对根据上述标准选择的成长型股票，通过行业发展前景、公司竞争力、财务状况、持续发展能力、公司管理水平、关联伙伴等指标对公司历史情况进行分析形成对公司基本面的判断；预期分析主要是通过各种预测数据和公司主营业务重大战略性调整对公司将来的发展前景作出判断。根据公司实际情况的差异，对发展前景良好，公司已积累相当可供分析的历史数据的企业，将以实证分析为主，结合预期分析的方式，进行综合判断；对因重大实质性变化或发展前景良好、尚无相当历史数据可供分析，但具备高速成长潜力的企业，将以预期分析为主，结合实证分析的方式进行综合判断。综合两方面的判断挑选出符合本基金投资要求的股票进行组合投资。

4、绩优型股票的选择

绩优型股票的选择，将基于对投资范围内的股票的稳定良好的业绩表现进行判断。此类股票应符合以下判断标准：所处行业发展稳定；公司规模较大，在行业中占有重要地位；公司主营产品竞争力较强，市场占有率较高，利润来源稳定；公司领导班子强，企业管理水平较高，财务行为规范；公司财务状况良好，有持续较高的盈利水平；公司总股本和流通股本相对较大，有较强的流动性，市盈率较低，股价相对比较合理。此类股票同时应满足连续三年已实现或预计可以实现的收益高于上市公司平均每股收益的选择条件。

这种判断主要通过对行业发展状况、公司在行业中的竞争优势、财务状况、持续盈利能力、分红派现能力、公司管理水平、股票市盈率等指标的分析形成对公司基本面的判断。本基金将挑选符合上述定性和定量要求的股票进行组合投资。

由于中国证券市场发展的时间较短，本基金目前主要依据定性的标准界定成长型和绩优型股票，随着相关数据积累的增加，本基金将建立智能化证券投资收益-风险分析交易系统，依据统计数据对成长型、绩优型股票进行量化分析，充实基金管理手段，使基金的投资决策依据更具科学性。

在防范风险，注重投资组合流动性，遵循中、长期投资，谋求基金稳定成长

的前提下，本基金将根据市场环境的变化，或基金管理人对公司基本面的判断，对认为市场价格偏离合理价格的股票，选择一定灵活的短期操作手段进行操作，以期获取较高的投资收益，力求基金净值或收益的最大化。

（七）投资决策

1、决策依据

（1）国家宏观经济环境，国家宏观经济环境是本基金投资决策的基础；

（2）国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定，依法决策是本基金进行投资的前提；

（3）财政货币政策、利率走势；

（4）地区及行业发展状况；

（5）上市公司研究；

（6）证券市场走势。

管理人的投资行为将受国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定的约束，并以充分保障投资者利益为前提，权衡投资中的收益和风险。

2、决策体系

本基金管理人内部设立由总经理、副总经理及相关人员组成的投资决策委员会、风险控制委员会，负责基金的投资决策和风险控制；公司内部职能部门研究策划部负责提供投资依据、基金管理部负责具体管理运作基金、监察稽核部负责日常的风险控制工作。

3、决策程序

（1）研究策划部对宏观形势、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进行分析、论证，并将有关研究分析报告报投资决策委员会，为其提供资产配置的依据，同时将有关报告提交基金经理。

（2）基金经理在综合上述报告和基金经理助理研究成果的基础上，对基金拟投资品种做进一步的调研、分析和论证，拟订所管理基金的投资计划、投资策略、投资组合方案和个股投资方案，提交投资决策委员会审核。

（3）投资决策委员会根据研究策划部提供的基本面分析报告及了解的外部信息，对基金经理提交方案的准确性和可操作性进行分析、论证，同时要求基金经理对重点投资项目进行答辩，并据此达成投资决策纪要，其中包括确定投资策略与原则，股票、国债、现金的资产配置比例，重仓投资品种等。

（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，由集中交易室执行。

（5）反馈机制：集中交易室在投资目标出现操作性问题和市场异动时需及时向基金经理反馈情况。基金经理对反馈信息分析后，根据权限决定是否调整投资指令、投资策略和投资组合方案，并将有关处理情况向基金部经理反馈。当基金经理通过市场观察发现原先对总体或单个重仓投资品种的判断可能有误时，需立即向投资决策委员会反馈。投资决策委员会接到反馈意见后进行论证、批复，基金经理根据批复调整投资组合，下达新的投资指令。

（6）基金管理部建立一套对重仓投资品种的管理办法。基金经理须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，以保证对重点投资目标信息的持续性全面掌握，完成基金的投资计划，尽量减低投资风险，保障基金受益人的利益。

(7) 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 and 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。

(8) 监察稽核部将以定期、不定期的方式对投资决策、执行、反馈的合法性、合规性进行全程的监察稽核。

(八) 基金经理

本基金由基金管理部下设的汉兴证券投资基金管理小组负责基金的日常投资运作，主要成员有：

王浩先生，基金经理，28岁，经济学硕士，五年证券从业经历，曾就职于中国经济开发信托投资公司上海证券部、海通证券有限公司基金部、富国基金管理有限公司基金管理部基金经理助理。

张晖先生，基金经理助理，28岁，经济学硕士，三年证券从业经历，曾就职于申银万国证券股份有限公司研发中心、富国基金管理有限公司研究策划部。

公司研究策划部还将在宏观环境分析、市场走势分析、行业分析及上市公司调研等方面为基金管理小组提供支持。

(九) 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，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

八、基金专用交易席位的选用

(一) 选择使用交易席位的证券经营机构的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，向其使用专用交易席位。基金管理人必须严格把握选择的标准，这些标准是：

- (1) 资力雄厚、信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示该公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范；
- (4) 内部管理规范、严格、具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有专门的研究机构和从事研究的人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济研究报告、行业分析报告、市场研究报告和个股分析报告及其它专项报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专项研究报告。

代理证券买卖的证券经营机构由基金管理人根据上述标准严格考察后确定。基金管理人和被选中的证券经营机构签定委托协议，报中国证监会备案并公告。

(二) 席位使用期限及更换方式

席位使用期限暂定为半年，使用期满后，基金管理人将根据证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，评价依据包括：

- (1) 提供的研究报告的数量和质量；
- (2) 研究报告被基金采纳的情况；

- (3) 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;
- (4) 因采纳其报告为基金运作避免或减少的损失;
- (5) 证券经营机构的资料库开放情况;
- (6) 由基金管理人提出课题, 由证券经营机构提供研究论文的情况。

根据上述综合评价的结果进行排名, 符合要求者继续使用, 否则, 予以剔除。在这一过程中, 基金管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行评价排名, 同时亦关注并接受暂未使用席位的证券经营机构的研究报告和信息资讯, 为半年后的席位更换做准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及资讯服务不符合基金管理人的要求, 基金管理人有权提前终止使用其交易席位。

(三) 席位运作方式

根据《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》的要求, 基金通过一个证券经营机构买卖证券的年成交量不得超过本基金买卖证券年成交量的 30%。基金管理人将根据该项规定并结合各证券经营机构提供研究报告及咨询服务的质量, 分配基金在各席位买卖证券的交易量。

(四) 其他事宜

基金管理公司将根据有关规定, 在基金中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露, 并向中国证监会报告。

本基金管理人管理的汉盛证券投资基金目前选用的是海通证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、江苏证券有限责任公司, 华福证券有限责任公司、山东省国际信托投资公司的交易席位。

九、风险揭示

本基金的投资存在风险, 主要有:

(一) 市场风险

本基金投资于证券市场, 证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响, 导致基金收益水平变化, 产生风险, 主要有:

1、政策风险。因国家政策, 如财政政策、货币政策、行业政策、地区发展政策等发生变化, 导致市场波动而影响基金收益, 产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化, 市场的收益水平也呈周期性变化。基金的主要投资对象—国债与上市公司的股票, 其收益水平也会随经济周期的变化而出现周期性变化, 从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率, 影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票, 其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响, 如市场前景、行业竞争、管理者素质、财务状况等, 这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善, 其股票价格可能下跌, 或者能够用于分配的利润减少, 使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险, 但不能完全规避, 从而给基金的投资带来风险。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配, 而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降。从而使基金实际投资收益下降, 如果基金的收益率不及通货膨胀率, 投资实际上就发生了亏损。

(二) 管理风险

在基金管理运作过程中由于管理人的主观因素，如管理人的知识、经验、判断、决策等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

保持投资目标的高流动性，是通过选择具有较大流通股本或具有较高流动性投资目标、控制投资目标的投资比例来实现，投资是依据对市场和投资目标的历史判断，由于市场情况的变化，可能使投资目标的流动性发生变化，进而产生投资目标的流动性风险。

对于成长型股票的投资，由于判断公司能否成为成长型公司，依据对公司历史的实证分析和对公司发展前景的预期，但股票投资的收益主要取决于公司未来实际的发展速度和盈利能力，公司实际发展速度和盈利能力不能达到预期的水平，可能导致股票价格的下跌或股息、红利的减少；对于绩优型股票的投资，主要依据对公司历史业绩的实证分析，而历史只能说明过去，因此绩优型股票的风险在于对公司持续盈利能力的判断失误。

本基金管理人同时管理多只基金，因此本基金进行具体投资时可能会受到其他基金投资时带来的影响，尽管本基金管理人制定了严格的交易规则以避免不同基金投资可能存在的利益冲突，但无法完全避免该影响的产生。

（三）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

十、基金资产

（一）基金资产总值

基金资产总值包括基金所拥有的股票、国债和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

基金资产净值是指基金资产总值减去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）基金资产的帐户

本基金资产以“汉兴证券投资基金专户”名义由托管行交通银行开立基金专用银行存款帐户及证券帐户，本基金专用帐户与基金管理人和基金托管人自有的资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

（四）基金资产的处分

本基金资产独立于管理人和托管人的资产，并由托管人保管。管理人、托管人以其自有的资产承担法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

十一、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

（二）估值日

每日对基金资产进行估值。

（三）估值方法

1、上市证券采用计算日证券交易所提供的当日市场平均价；该日无交易的，以最近交易日当日平均价计算；

2、未上市的股票以其成本价计算；

3、未上市国债及未到期银行存款，以本金加计至估值日为止的应计利息额计算；

4、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，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资产。

（五）估值程序

基金日常估值由管理人进行。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给基金托管人，基金托管人按基金合同约定的估值方法、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）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因其他不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

十二、基金费用

（一）基金费用的种类

- 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、基金持有人大会费用；
- 7、会计师费用和律师费用；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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，当基金的年度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）

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期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内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（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 基金可分配净收益年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市场平均收益率；
- 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：

业绩报酬 = 调整后期初资产净值 × MIN[M, N] × 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；

基金可分配净收益率 = 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的基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期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内从基金资产中一次性支取。

3、上述（一）中 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。

（三）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的费用等不列入基金费用。

（四）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人报酬和基金托管费。经中国证监会批准后公告，此项调整无须召开持有人大会。

十三、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，根据国家有关规定，依法纳税。

十四、基金收益与分配

（一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（二）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 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。

（三）收益分配方案

基金收益方案中载明基金收益的范围、基金净收益、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。

（四）收益分配方案的确定与公告

本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。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 2、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 3、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 4、本基金独立建帐、独立核算；
- 5、本基金管理人及托管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、基金托管人每月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、本基金管理人聘请具有证券从业资格的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、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经托管人（或管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在五个工作日内公告。

十六、交易安排

本基金成立之后，将根据《暂行办法》及有关规定，申请在上海证券交易所上市。上市时间预计在基金发行后一个月内。

十七、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

本基金年报经注册会计师审计后，在基金会计年度结束后的 90 日内公告；中期报告在基金会计年度每半年结束后的 60 日内公告。

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》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、基金资产净值的公告：

本基金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、基金投资组合的公告：

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

本基金获准在上海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上海证券交易所备案。

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、重大关联交易；
- 10、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、基金定期公告、临时公告等文本在编制完成后，放置于基金管理人和基金托管人所在地，基金持有人可免费查阅。在支付工本费后，可取得上述文件复印件。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十八、基金持有人

（一）基金持有人的权利与义务

1、基金持有人权利

- （1）出席或者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) 取得基金清算后的剩余资产;
- (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。

2、基金持有人义务

- (1) 遵守基金契约;
- (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。

(二) 基金持有人大会

1、召开事由

有以下情形之一的, 召开基金持有人大会:

(1) 修改基金契约; 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) 基金扩募;
- (7) 变更基金类型;
- (8) 中国证监会规定的其他情形。

2、召集方式

- (1) 在正常情况下, 基金持有人大会由基金管理人召集;
- (2) 在更换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) 在基金管理人和基金托管人均无法行使召集权的情况下, 由本基金发起人召集基金持有人大会。

3、通知

召开基金持有人大会, 召集人于会议召开前 10 天, 在《中国证券报》和《上海证券报》等证监会指定的全国性报刊上公告。基金持有人大会通知将至少载明以下内容:

- (1) 会议召开的时间、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和地点;
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

4、出席方式

- (1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以授权委托书委派代表出席;
- (2) 书面开会。如采取书面开会的方式, 召集人将事先报请中国证监会同意。书面开会以通讯表决方式进行表决。

5、议事内容与程序

- (1) 议事内容: 关系基金持有人利益的重大事项, 如修改基金契约、提前

终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、延长基金期限、变更基金类型以及召集人认为需提交基金持有人大会讨论的其他事项。

(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，在公证机构监督下形成决议，报经中国证监会批准后公告。

6、表决

(1) 基金持有人所持每份基金单位有一票表决权；

(2) 基金持有人大会决议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份额的基金持有人通过；

(3) 基金持有人大会决议对所有基金持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

7、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。

十九、基金发起人

(一) 基金发起人情况

1、海通证券有限公司

法定代表人：王开国

注册地址：上海市唐山路218号

组织形式：有限责任公司

注册资本：10亿元人民币

设立日期：1994年1月7日

营业期限：持续经营

经营范围：承销有价证券；自营买卖、代理买卖有价证券；发行和代理发行有价证券；有价证券抵押、贴现；开展基金业务；经营与证券业务有关的投资业务；有价证券的代保管、过户、见证，代理还本付息和分红派息；境外证券业务，经中国人民银行批准的其他证券业务。

财务状况：海通证券有限公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

2、江苏证券有限责任公司

法定代表人：张开辉

注册地址：江苏省南京市管家桥87号

组织形式：有限责任公司

注册资本：4.04亿元人民币

设立日期：1992年12月21日

营业期限：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。

财务状况：江苏证券有限责任公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

3、富国基金管理有限公司

法定代表人：虞志皓

注册地址：北京建国门外大街1号国贸中心西楼6层601室

组织形式：有限责任公司

注册资本：1亿元人民币

设立日期：1999年4月13日

营业期限：持续经营

主要业务：基金管理业务；发起设立基金。

财务状况：本基金管理公司成立于1999年4月13日，目前为汉盛证券投资基金的管理人。

（二）基金发起人的权利与义务

1、基金发起人的权利

- （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）依据有关规定转让基金单位；
- （6）监督基金经营情况，获取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。

2、基金发起人的义务

- （1）公告招募说明书；
- （2）在基金设立时认购和在存续期间持有符合规定比例的基金单位；
- （3）遵守基金契约；
- （4）承担基金亏损或者终止时的有限责任；
- （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所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。

二十、基金管理人

（一）基金管理人情况

1、名称：富国基金管理有限公司

2、设立日期：1999年4月13日

3、法定代表人：虞志皓

4、注册资本：10000万元人民币

5、注册地址：北京建国门外大街1号国贸中心西楼六层

6、设立概况：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共同发起，经中国证监会证监基金字[1999]11号文批准成立。

7、主要人员情况

（1）董事会成员

虞志皓先生，董事长。58岁，经济师，研究生学历。历任中国人民银行普陀区办事处组长；工商银行长宁区信贷科科长，信托投资公司科长；申银证券公司市场部经理，浦安公司副总经理，总裁助理兼发展公司总经理，浦西管理总部总经理；申银万国证券股份有限公司浦西管理总部总经理，申银万国证券股份有限公司总监。

李建国先生，董事，总经理。36岁，中共党员，经济师，研究生学历，在读

博士生。历任河南省金融干部管理学院教员；河南省证券公司交易开发部副经理，研究发展部兼投资部总经理，上海业务部总经理，河南证券总经理助理，总经理；海通证券有限公司副总经理；现任富国基金管理有限公司总经理。

汪精周先生，董事。37岁，博士学位。历任南京大学数学系教员；东南大学应用数学系应用数学教研室主任、副教授、江苏省金融数学专业委员会主任；江苏证券有限责任公司研发中心高级经理，现任江苏证券有限责任公司交易部副总经理。

董舒萍女士，董事。43岁，中共党员，大学专科。历任福建省电信局职工；福州军区通信营教导员、营党委书记；福建国际信托投资公司总裁办副主任、主任，现任福建信托投资公司信托部总经理。

巴天先生，董事。41岁，高级工程师，研究生。历任山东省国际信托投资公司合资合作部经理；山东鲁信国际经济股份有限公司总经理；鲁信（德国）经济发展公司总经理；山东省国际信托投资公司证券总部总经理。

（2）监事会成员

陆冬梅女士，监事长。35岁，中共党员，大学本科学历。历任江苏证券有限责任公司会计处副处长；江苏证券有限责任公司稽查室主任；江苏证券有限责任公司稽查监察部主任。

王增祥先生，监事。65岁，中共党员，高级会计师，全国信托会计学会副会长，专科毕业。历任福建化工设计院总会计师；福建国际信托投资公司财务处长、副总会计师。

于渭明，监事。36岁，中共党员，研究生学历。历任山东泰安财政局、华夏银行济南分行干部、现任山东省国际信托投资公司计划财务部经理。

江其务先生，监事。67岁，中共党员，教授，博士生导师。历任陕西财经学院教授、博士生导师；中国金融学院教授、博士生导师、学术委员会副主任；金融发展研究所所长；中国人民银行学术委员会委员；中国金融学会常务理事；香港特别行政区学术评审局委员。

林志松先生，监事。30岁，中共党员，大学本科。曾在漳州商检局办公室、晋江商检局检验科工作，其间负责晋江商检局龙湖办事处工作；厦门证券公司投资发展部工作，其间借调厦门证监会、中国证监会工作；现任职富国基金管理有限公司监察稽核部。

（3）经理及其他高级管理人员

李长伟先生，副总经理。34岁，中共党员，经济学硕士，讲师。历任河南省政府发展研究中心干部；中央党校经济学部讲师；申银万国证券股份有限公司海口营业部总经理、北京管理总部副总经理兼北京营业部总经理。

谢卫先生，副总经理。34岁，经济学博士，高级经济师。历任中央财经大学金融系教员；中国社会科学院财经所助理研究员；中国电力信托投资公司基金部副经理；中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理。

魏青先生，督察员，总经理助理。33岁，研究生学历。历任中国新技术投资公司金融部、证券部项目经理；华夏证券有限公司基金部副总经理。

基金管理公司现有员工30人，58.6%以上具有硕士以上学历，业务人员82.8%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

8、部门设置

富国基金管理有限公司常设基金管理部、研究策划部、监察稽核部、财务管理部和行政管理部。此外，还设立投资决策委员会和风险控制委员会两个专门委员会。

(1) 基金管理部

基金管理部由各基金管理小组和中央交易室组成，根据投资决策委员会的安排和制定的投资原则，对公司所管理基金下达投资指令，并负责执行，同时进行相关研究分析工作。各基金管理小组之间保持独立。

基金管理部经理负责协调各基金间交叉投资问题，中央交易室负责处理日常交易。在出现各基金对同一只证券的交叉交易时，按以下原则处理：

① 出现同买、同卖时，以平等原则和平衡原则并考虑指令下达的时间和交易价格，为各基金输入交易指令，确保以合理价格完成各基金的交易指令。

② 出现一买一卖时，必须立即上报监察稽核部和基金管理部经理，在核准后方可执行，防止本公司所管理各基金间的关联交易。

(2) 研究策划部

负责对宏观经济形势、国内外市场、行业、上市公司、债券研究，信息收集及企划、基金新产品的开发研究工作。研究成果由本基金管理人管理的所有基金共享。

(3) 监察稽核部

负责对基金运作和公司内部管理的监察和稽核；风险事项及法律纠纷的处理；协助管理层调查、评估内部风险控制制度是否准确、完整、全面、有效，以及内部风险控制制度的执行情况；信息披露及保密管理。

(4) 行政管理部

负责公司行政事务，文件起草及议定事项的核定和督办，文件档案管理，人事及劳资管理，人员培训，公司后勤保障，电脑系统技术设施保障。

(5) 财务管理部

负责公司经营活动中的资金计划及管理，公司财务会计核算及财务管理；基金会计清算、核算。

两个专门委员会：

(1) 投资决策委员会

投资决策委员会为非常设议事机构，由公司总经理、副总经理、基金管理部经理和相关部门人员组成，负责制定各项投资决策和原则、投资计划、投资策略和重仓投资品种。

(2) 风险控制委员会

风险控制委员会由公司总经理、副总经理、督查员和监察稽核部等有关人员组成。负责对基金投资的风险评估和防范，进行重点风险监督、控制与管理。就基金投资制定控制公司内部风险的政策，并在市场发生重大变化的情况下，研究制定风险控制的办法。

本基金管理人根据市场情况的变化、内部管理方式的改变，可能会对现有的机构设置及决策程序进行适当的调整。

9、内部控制、监察及稽核、财务及人事管理制度建立情况

建立健全管理公司的规章制度是基金管理公司的基础性工作，也是保护基金投资者的重要措施。除《公司章程》外，富国基金管理有限公司还制定了以下制度：

(1) 内部控制制度

主要相关制度包括：①严格按照《暂行办法》、基金契约规定的投资比例进行投资，并不得从事《暂行办法》所禁止的业务。②基金管理公司将所管理基金资产与管理公司自有资产实行分帐管理。③按照基金业务前台和后台分离的原则，建立岗位分离制度，各业务部门的业务和人员要严格分离，按各自职责独立负责。④投资决策实行集体决策，专人负责的制度。投资决策符合基金契约的规定；投资决策报告要与执行报告一致。⑤实施集中交易制度，投资指令下达和交易执行分离，设立专门的中央交易室。⑥基金管理部的投资执行实行标准化作业，每项工作有书面记录。⑦实行严格的信息分级管理、保密制度。⑧公司全部配录音电话，电话录音保存5年；记录所有交易情况，并保留交易记录不少于15年。⑨实行独立的稽核检查制度，监察稽核部直接对公司总经理负责，有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并独立地对总经理报告。

（2）内部稽核制度

公司设督察员，全权负责管理公司的监察稽核工作。督察员由总经理提名，其任免经董事会审议，报中国证监会核准。督察员可列席公司的会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核，每月应独立出具稽核报告，报送中国证监会和管理公司董事长。如发现管理公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和管理公司董事长报告。

监察稽核部直属总经理领导，以公正独立、实事求是的精神进行内部稽查工作。

稽核部的职能：①检查公司各部门执行国家有关法律、法规、金融政策情况；②检查监督公司各部门执行公司各项规章制度、内部监控及有关决定的情况；③审查公司所管理基金资产及自有资产的经营情况及经营效益；④负责基金会计和公司会计的内部审计；⑤调查公司内部的经济违法案件。

稽核部的权限：①有权要求各业务部门提供有关经营管理计划及其执行情况，提供报表、制度、规定、办法等文件资料，负责检查被稽核部门的会计凭证、帐簿和报表，查阅有关合同、文件和资料；②经总经理同意，有权参加公司及被稽核部门的有关会议，参与研究和处理稽核中发现的问题；③负责对检查中发现的问题或有关方面提供的情况进行查证核实，复制有关凭证、帐页、索取证明材料。对有疑问的情况有权要求被稽核部门作出解释和提供有关资料或书面说明；④对基金管理中存在的违法、违规或不合理的经济业务活动，负责提出制止、纠正和处理意见；⑤对拒绝、隐瞒、毁灭证据的部门或个人，有权建议公司管理层追究直接责任人和领导的责任；⑥负责按照国家和公司有关规定，对被稽核部门及有关人员的违规、违法行为提出处理意见。

针对本公司管理多家基金的情况，监察稽核部将对投资决策、执行、反馈的合法性、合规性进行全程监察稽核，实时监控投资组合规定各项比例的执行情况；监督各基金独立运作的情况，避免各基金之间信息的交叉；杜绝本公司管理的各基金之间的内幕交易、交叉交易及其它法律、法规禁止的行为；

（3）财务管理制度

基金管理公司的财务制度主要是有效运用管理公司自有资产，做好财务核算，控制成本，维护公司股东的权益。主要内容有：公司财务与基金财务严格分开；按照《暂行办法》的规定运用好公司自有资金；严格财务管理，控制成本开支；做好公司固定资产管理。

（4）人事管理制度

基金管理公司的人事制度是建立激励、约束机制，吸引优秀人才，并通过培

训提高员工素质，规范员工行为，保护员工的正当权益。主要内容包括：员工聘用；岗位聘任及轮换交流；对各级管理人员和员工的定期考核，奖惩和任免；加强培训工作，提高员工素质；薪资福利；档案管理。

10、经营状况

(1) 截止 1999 年 9 月 30 日，本基金管理人管理的基金为“汉盛证券投资基金”；其基本情况如下：

- ① 基金名称：汉盛证券投资基金
- ② 基金成立时间：1999 年 5 月 10 日
- ③ 基金单位总份额：20 亿份
- ④ 基金资产净值：26.89 亿元
- ⑤ 基金单位净值：1.3446 元
- ⑥ 基金净值增长率：34.46%

(2) 汉盛证券投资基金由汉盛基金管理小组负责，主要成员有：

金涛先生，基金经理，28 岁，经济学硕士，五年金融、证券从业经历，曾就职于交通银行上海分行调研部、海通证券有限公司资产运用部、基金部、富国基金管理有限公司基金管理部基金经理助理。

洪伟杰先生，基金经理助理，29 岁，工商管理硕士，三年证券从业经历，曾就职于海南港澳国际信托投资有限公司投资银行部、富国基金管理有限公司研究策划部分析师。

(3) 本基金管理人成立于 1999 年 4 月 13 日，注册资本 1 亿元人民币，实收资本 1 亿元人民币。截止 1999 年 9 月 30 日，总资产达 1.14 亿元，净资产达 1.10 亿元。

(二) 基金管理公司章程摘要

第九条 公司的经营宗旨为：根据国家法律、法规及其他有关规定，坚持诚实信用、勤勉尽责的原则，以专业经营方式管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，使公司稳步、健康发展。

第十条 公司经营范围为：

- 1、基金管理业务；
- 2、发起设立基金。

第十二条 公司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五家公司共同发起设立。

第二十一条 公司设股东会，股东会由全体股东组成，是公司的最高权力机构。

第二十七条 公司设董事会，向股东会负责。

公司董事须为具有权力能力和行为能力的自然人，其任职须经中国证监会核准。

第三十二条 公司董事不得兼任其他基金管理公司的高级管理职务，不得直接或间接进行股票、基金及类似投资工具的交易，或利用公司专有或保密的信息为个人或其亲友的证券活动谋利。

第四十五条 公司设监事会。监事会由五名监事组成，其中：股东代表三名，专家代表一名，职工代表一名。经监事会 2/3 以上监事同意，推选一名监事作为监事长。

公司监事的任职应报中国证监会备案。

第五十五条 公司总经理向董事会负责。

第五十六条 公司设总经理一名，副总经理二名。总理由董事会聘任或解聘。副总经理由总经理提名，董事会聘任或者解聘。副总经理协助总经理工作。

总经理、副总经理任期三年。经董事会连聘可以连任。

总经理、副总经理的任职资格须经中国证监会核准，总经理助理、部门经理的任职须报中国证监会备案。

第六十二条 总经理行使下列职权：

- (一) 主持公司的日常经营管理工作；
- (二) 执行董事会决议，组织实施公司年度经营计划和公司资产投资方案；
- (三) 拟订公司内部管理机构设置方案；
- (四) 拟订公司的基本管理制度；
- (五) 制订公司的具体规章；
- (六) 提请董事会聘任或者解聘公司副总经理、财务负责人、督察员，但聘任或解聘副总经理或督察员应报中国证监会核准；
- (七) 聘任或者解聘除应由董事会聘任或者解聘以外的管理人员，包括总经理助理、部门经理；
- (八) 拟定公司职员的工资、福利、考核、奖惩制度；
- (九) 本章程和股东会授予的其他职权。

总经理助理、部门经理的任职须报中国证监会备案。

第六十五条 督察员可列席公司的会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核，每月应独立出具稽核报告，报送中国证监会和管理公司董事长。

如发现管理公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和管理公司董事长报告。

第六十九条 公司不得与任何人订立将公司所管理基金资产的业务交于该人负责的合同或协议。

(三) 基金管理人的更换

1、有下列情形之一的，经中国证监会批准，可以更换基金管理人：

- (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) 基金托管人有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职责的。

2、基金管理人的更换程序

- (1) 提名：新任基金管理人由基金托管人提名；
- (2) 决议：基金持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议；
- (3) 批准：经中国证监会审查批准后，新任基金管理人方可继任，原任基金管理人方可退任；
- (4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金主要发起人在中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

(四) 基金管理人的禁止行为

基金管理人依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定，诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产，不为自己或任何第三者谋取利益。

基金管理人在管理运作基金资产时，不得从事以下行为：

1. 将本基金资产投资于其他基金；
2. 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
3. 从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
4. 动用银行信贷资金从事基金投资；
5. 将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
6. 从事证券信用交易；
7. 以基金资产进行房地产投资；
8. 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
9. 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；
10. 中国证监会规定禁止从事的其他行为。

(五) 基金管理人受处罚情况

本基金管理人无任何受处罚记录。

(六) 基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

- (1) 依法运用基金资产；
- (2) 依本基金契约规定获得基金管理人报酬；
- (3) 依照有关规定，代表基金行使股东权利；
- (4) 监督基金托管人，如果基金托管人违反了本基金契约及国家有关法律、法规，基金管理人应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(5) 《暂行办法》、基金契约以及有关法律、法规规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

- (1) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (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、财务管理及人事管理等制度，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，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人运作基金资产；
- (5) 接受基金托管人的监督；
- (6) 按规定计算并公告基金净值及基金单位每份资产净值；
- (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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、基金契约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，不向他人泄露；
- (9) 按规定向基金持有人分配基金收益；
- (10) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (11) 依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定召集基金持有人大会；
- (12) 保存基金的会计帐册、报表、记录 15 年以上；
- (13) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(14) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(15) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(16) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

(17) 有关法律、法规规定的其他义务。

二十一、基金托管人

基金托管人情况

1、基本情况

名称：交通银行

设立日期：1987年4月1日

注册资本：120亿元人民币

法定代表人：王明权

注册地址：上海市仙霞路18号

发展概况：交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行。自1987年重新组建以来，各项业务稳步、健康发展。交通银行1998年被世界权威金融杂志《欧洲货币》评为中国最佳银行。

财务状况：到1998年末，资产总额为4839.23亿元，实收资本117亿元；1998年境内实现利润25.48亿元，人均创利5.61万元。交通银行自重新组建以来，保持连续盈利的记录，实现利润总额和人均利润水平名列国内五大银行前列。

2、基金托管部门设置及员工情况

交通银行总行设立证券投资基金托管部，主要业务部门有监管交易部、清算核算部、内控巡查部、综合规划部。现有员工17人。

3、主要人员情况

王明权先生，交通银行行长。52岁，经济学硕士，高级经济师。1992年12月至1993年8月任交通银行副行长、党组成员；1993年9月至今任交通银行行长、党委书记。

刘育长先生，交通银行副行长，主管交通银行总行证券投资基金托管业务。57岁，高级经济师。1992年9月至1996年9月，任交通银行上海分行行长、党组书记；1996年10月至今任交通银行副行长、党委成员。

谢红兵先生，交通银行证券投资基金托管部负责人。49岁，大学学历，曾任交通银行上海分行杨浦支行副行长（主持工作）、上海分行营业处处长、静安支行行长、杨浦支行行长；1998年5月至今任交通银行证券投资基金托管部负责人。

张咏东先生，交通银行基金托管部监管交易部经理。30岁，经济学学士，经济师。

林侃先生，交通银行基金托管部清算核算部经理，31岁，经济学硕士，中国注册会计师。

苏玉平女士，交通银行基金托管部内控巡查部经理，28岁，经济学硕士。

谷娜莎女士，交通银行基金托管部综合规划部经理，44岁，大专学历，经济师。

4、交通银行目前托管普惠基金和安顺基金。

(二) 基金托管人的更换

1、更换托管人的条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，更换基金托管人：

- (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) 基金管理人认为有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%以上基金份额的基金持有人要求基金托管人退任的；
- (4) 中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

2、托管人的更换程序

- (1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名；
- (2) 决议：基金持有人大会对被提名的新任基金托管人形成决议；
- (3) 批准：经中国证监会和中国人民银行审查批准后，新任基金托管人方可继任，原任基金托管人方可退任；
- (4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续，并与交接管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金发起人在获得批准后 5 个工作日内公告。

(三) 基金托管人禁止行为

基金托管人按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产和监督基金管理人的运作，不为自己或任何第三人谋取利益。基金托管人不从事以下行为：

- 1、从事基金投资；
- 2、挪用本基金资产；
- 3、在本基金信息公开披露前，向他人泄露有关信息。

(四) 基金托管人受处罚情况

最近三年内基金托管人及其负责基金托管业务的高级管理人员未受到中国证监会、中国人民银行及工商、财税及其他有关机关的处罚。

(五) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依法监督基金管理人的投资运作，保管基金的资产；
- (2) 依本基金契约规定获得基金托管费；
- (3) 法律、法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；
- (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、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与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、帐册记录等方面相互独立；

(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基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 以基金的名义设立证券帐户、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) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、基金契约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，不向他人泄露；

- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；
- (9) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；
- (10) 建立并保存基金持有人名册，并负责基金单位转让的过户和登记；
- (11) 按有关规定，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) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益；
- (14) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (15) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (16) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (17) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (18) 法律、法规规定的其他义务。

二十二、基金终止

有下列情形之一的，基金将终止：

- (一) 封闭期满，未被批准续期的；
- (二) 基金经批准提前终止的；
- (三) 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- (四) 有关法律、法规规定的其它情形。

二十三、基金的扩募、续期或转型

(一) 基金的扩募与续期

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）开放式基金所必需的人才、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。

二十四、基金清算

(一) 基金清算小组

- 1、 自基金终止之日起三个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证

监会的监督下进行基金清算。

2、基金清算小组成员由基金发起人、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、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金持有人持有的基金份额比例进行分配。

(五) 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；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金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。

(六) 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。

二十五、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

备查文件

- 1、中国证监会批准汉兴证券投资基金设立的文件
- 2、《汉兴证券投资基金基金契约》
- 3、法律意见书
- 4、基金发起人的营业执照
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其它文件