

# 东方龙混合型开放式证券投资基金 招募说明书（更新） （2006年第2号）

**基金管理人：东方基金管理有限责任公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**日期：二 七年一月**

## 重要提示

东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2004 年 9 月 24 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方龙混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2004]152 号）和《关于募集东方龙混合型开放式证券投资基金的确认函》（基金部函[2004]117 号）的核准，进行募集。本基金基金合同于 2004 年 11 月 25 日正式生效。本基金为混合型开放式。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本《招募说明书》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日(财务数据未经审计)，本招募说明书其他所载内容截止日为2006年12月20日。

本《招募说明书》已经本基金托管人复核。

## 目 录

一、 绪 言 .....	4
二、 释 义 .....	4
三、 基金管理人 .....	8
四、 基金托管人 .....	9
五、 相关服务机构 .....	20
六、 基金的募集与基金合同的生效 .....	27
七、 基金份额的申购与赎回 .....	27
八、 基金的投资 .....	33
九、 基金的业绩 .....	42
十、 基金的财产 .....	44
十一、 基金资产的估值 .....	44
十二、 基金的收益与分配 .....	49
十三、 基金的费用与税收 .....	49
十四、 基金的会计与审计 .....	53
十五、 基金的信息披露 .....	53
十六、 风险揭示 .....	57
十七、 基金的终止与清算 .....	59
十八、 基金合同的内容摘要 .....	61
十九、 基金托管协议的内容摘要 .....	70
二十、 对基金份额持有人的服务 .....	75
二十一、 其他应披露事项 .....	77
二十二、 招募说明书的存放及查阅方式 .....	78
二十三、 备查文件 .....	78

## 一、 绪 言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、其他有关规定及《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”或“基金合同”)编写。

本《招募说明书》阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》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、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权其他任何人对未在本《招募说明书》中载明的信息,或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者取得依基金合同所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金合同。

## 二、 释 义

在《本基金招募说明书》中,除非文义另有所指,下列词语具有如下含义:

基金或本基金:	指东方龙混合型开放式证券投资基金
基金合同或本基金合同:	指《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充
招募说明书或本招募说明书:	指《东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书》,本基金合同生效后,基金管理人在每六个

	月结束之日起 45 日内，定期更新招募说明书
基金份额发售公告：	指《东方龙混合型开放式证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议或本托管协议：	指《东方龙混合型开放式证券投资基金托管协议》
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》
《销售办法》：	指《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》：	指《证券投资基金信息披露管理办法》
法律法规：	指中国现行有效的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构：	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金管理人或本基金管理人：	指东方基金管理有限责任公司
基金托管人或本基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括基金份额持有人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为东方基金管理有限责任公司
基金投资者：	指个人投资者和机构投资者
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者（法律法规禁止购买者除外）

机构投资者：	指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织及合格境外机构投资者（法律法规禁止购买者除外）
合格境外机构投资者：	指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的开放式证券投资基金的中国境外的机构投资者
元：	指人民币元
基金募集期：	指自基金份额发售之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过3个月
基金合同生效日：	指基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续完毕后，东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同生效的日期
基金合同终止日：	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金合同的日期
存续期：	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
认购：	指本基金在募集期内基金投资者向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为
申购：	指基金在存续期间基金投资者向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金在存续期间基金份额持有人要求基金管理人接受其申请注销本基金份额的行为
巨额赎回：	指本基金单个开放日净赎回申请超过基金总份额的10%时
转换：	指基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人

	要求基金管理人接受申请将其持有的本基金份额转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为
转托管：	指基金份额持有人将其所持有的某一基金份额从一个交易账号指定到另一交易账号进行交易的行为
直销机构：	指东方基金管理有限责任公司
代销机构：	指接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理本基金销售业务的机构
销售机构：	直销机构及代销机构
基金销售网点：	指直销机构销售网点及代销机构销售网点
基金账户：	指注册登记机构为基金份额持有人开立的、记录其持有的、由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
开放日：	指为基金投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
T日：	指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他投资等的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
指定媒体：	指中国证监会指定的、用以进行信息披露的报纸和互联网网站
不可抗力：	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人

	签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易
--	--

### 三、 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市海淀区中关村东路 99 号

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

法定代表人：李维雄

总经理：程红

成立日期：2004 年 6 月 11 日

注册资本：1 亿元人民币

经营范围：发起设立基金；基金管理；法律法规允许和中国证监会核准的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：1100001704226

联系人：孙晔伟

电话：010-66295888

股权结构：

持股单位	出资金额(人民币)	占总股本比例
东北证券有限责任公司	4600 万元	46%
四川南方希望实业有限公司	1800 万元	18%
上海市原水股份有限公司	1800 万元	18%
河北宝硕股份有限公司	1800 万元	18%



合 计	10,000 万元	100%
-----	-----------	------

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制。本公司董事会下设合规及内部控制委员会、提名及资格审查委员会和薪酬及考核委员会三个非常设机构；本公司设督察长，领导监察稽核部，负责公司的监察稽核工作；本公司下设风险控制委员会、投资决策委员会和研究部、基金管理部、交易部、市场部、信息技术部、登记清算部、金融工程部、监察稽核部、人力资源部、行政部十个职能部门。

(二) 基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

李维雄先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。1988年起先后在吉林省政府办公厅、吉林省信托投资公司、吉林省财政厅工作，1999年任吉林证券重组领导小组组长，2000年起任东北证券有限责任公司董事长兼总裁，2001年6月起任东北证券有限责任公司总裁，现任本公司董事长。

李树先生，董事，大学本科，注册审计师。历任吉林省轻工业局、吉林省工业厅副处长、处长、主任、总经理，吉林省经济体制改革委员会副秘书长、秘书长、副主任、党组副书记、党组书记、主任，吉林省证券管理办公室主任，中共吉林省政策研究室主任，吉林省人民政府副秘书长、吉林省经济贸易委员会主任，现任东北证券有限责任公司董事长。

李晓东先生，董事，EMBA。历任中国航空油料西南公司副科长、副处长，深圳中油空港实业股份有限公司副总经理，新希望集团金融事业部总经理，中国民生银行董事，现任福建联华国际信托投资有限公司常务董事、总裁，中联实业股份有限公司常务董事。

吴守培先生，董事，大学本科，高级经济师。历任上海杨浦煤气厂厂长、党委书记，上海市原水股份有限公司副总经理、党委书记，现任上海市原水股份有限公司总经理、党委副书记。

周山先生，董事，大学本科，教授级高级工程师，第十一届全国人大代表。历任保定赛片厂厂长，保定塑料厂厂长，保定塑料总厂厂长；曾任河北宝硕集团有限公司董事长、总经理、党委书记，河北宝硕股份有限公司董事长。

程红女士,董事,会计学硕士,高级经济师。历任中国建设银行吉林省分行房贷部业务经理,吉林省信托投资公司长春解放大路营业部副总经理,东北证券有限责任公司北京总部总经理、总裁助理,东方基金管理有限责任公司副总经理、代理总经理,现任本公司总经理。

黑学彦先生,独立董事,大学本科,高级经济师。历任吉林省委财贸部基层工作处处长,吉林省经委进出口处处长,吉林省商业厅副厅长,吉林省国际信托公司董事长、总经理兼党组书记,海南省国际信托投资公司董事长、总经理、党委书记,中国证券业协会副秘书长,银华基金管理有限责任公司董事长。

宋冬林先生,独立董事,经济学博士,教授。现任长春税务学院院长,吉林大学经济学院经济学教授,博士生导师,享受国务院政府津贴。

刘锋先生,独立董事,金融学博士,教授。现任加中金融协会副会长,中国人民银行研究生部皇家银行访问教授,麦吉尔大学教授,中加合作组建的(上海)国际银行学院执行院长。

## 2、监事会成员

白磊先生,监事,管理学硕士。历任上海市原水股份有限公司财务部副经理、经理,现任上海市原水股份有限公司财务负责人。

何俊岩先生,监事,会计学学士,高级会计师。历任吉林省五金矿产进出口公司财务科长,东北证券证券有限责任公司计划财务部总经理、受托资产管理总部总经理,现任东北证券证券有限责任公司财务总监。

杨晓燕女士,监事,哲学硕士,金融学研究生,高级经济师。曾任职北京银行等金融机构,10余年金融、证券从业经历,现任本公司监察稽核部经理。

## 3、其他高级管理人员

程红女士,总经理,简历请参见董事介绍。

孙晔伟先生,督察长,经济学博士,副研究员。历任吉林省社会科学院助理研究员,吉林省光华律师事务所执业律师,东北证券有限责任公司北京投资银行部总经理、北京总部总经理,现任本公司督察长。

## 4、本基金基金经理

2004年11月25日至2006年3月3日,宋炳山先生任本基金基金经理;2006年3月3日至今,杜位移先生任本基金基金经理。

杜位移先生,中国人民银行总行金融研究生所金融学专业研究生,经济学硕士,7年金融、证券从业经历。曾先后在首钢总公司、大成基金管理有限公司、富国基金管理有限公司工作,2005年加盟本公司,曾任研究部经理。2006年3月3日至今任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

程红女士:总经理,投资决策委员会委员。

付勇先生:东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理,总经理助理,投资决策委员会委员,北京大学金融学博士研究生,会计学硕士,数学学士。10余年金融、证券从业经历,曾先后在中国建设银行总行、华龙证券有限责任公司、东北证券有限责任公司工作;2004年加盟本公司,曾任发展规划部经理、投资总监助理、本基金基金经理助理。

杜位移先生:本基金基金经理,投资决策委员会委员。

季雷先生:研究部经理,投资决策委员会委员,经济学博士、MBA、物理学士。5年证券从业经历,2001年至2004年在东北证券有限责任公司金融与产业研究所工作,任投资策划部经理;2005年加盟本公司,曾任本基金基金经理助理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### (三) 基金管理人职责

##### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金,办理基金备案手续;
- (2) 自本基金合同生效之日起,依照法律法规和本基金合同的规定独立管理基金财产,进行证券投资;
- (3) 根据本基金合同的规定,制定并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则;
- (4) 依据法律法规和基金合同的规定,获得基金管理人的管理费,收取或委托收取基金投资者认购费、申购费、赎回费及其他事先公告的合理费用以及其

他费用；

(5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(6) 依据本基金合同及有关法律规定的规定监督本基金托管人，如认为本基金托管人违反了本基金合同及国家法律法规，并对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会、银行业监督管理机构，并采取其他必要措施保护基金份额持有人的利益；

(7) 根据本基金合同规定销售基金份额；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售机构的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益；

(9) 依照有关法律法规，代表本基金行使因基金投资而形成的股东权利或其他任何权利；

(10) 在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，拒绝或暂停受理申购申请，暂停受理赎回申请；

(11) 办理基金的注册登记业务或委托其他机构代理该项业务；

(12) 负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用；

(13) 依据有关法律法规及本基金合同的规定决定基金收益的分配方案；

(14) 依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定召集并参加基金份额持有人大会；

(15) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下依法为基金融资；

(16) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

(3) 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；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记业务或委托其他机构代理该项业务；

(6) 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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

(8) 依法接受基金托管人的监督；

(9) 采取适当、合理的措施保证计算本基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(10) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(11) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(12) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(13) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(17) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；并且保证基金投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与本基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(18) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销、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;

(20) 因过错导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;

(21) 本基金托管人因过错造成基金资产损失时,应为基金向本基金托管人追偿;

(22) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(23) 负责为基金聘请注册会计师和律师;

(24) 有关法律法规规定的其他义务。

#### (四) 基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事任何违反《证券法》、《基金法》以及其他相关法律法规的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,积极防止此类行为的发生。

2、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

#### 3、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定,本着敬业、诚信和谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不利用职务之便为自己、或任何第三者谋取利益;

(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开

的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不担任基金托管人或者其他基金管理人的任何职务，不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制制度

###### (1) 内部控制的原则

1) 健全性原则：内部控制应当包括本公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。

3) 独立性原则：本公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

4) 相互制约原则：本公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

5) 成本效益原则：本公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

###### (2) 内部控制的主要内容

###### 1) 控制环境

控制环境构成本公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、本公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造本公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于本公司各部分、岗位和业务环节。

董事会负责本公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对本公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

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。

建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度,严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度,确保本公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2) 风险评估

内部稽核人员定期评估本公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素,评估这些因素对本公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报本公司董事会及高级管理人员。

## 3) 组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次:董事会层面对本公司经营管理过程中的风险控制工作的指导;

公司董事会通过其下设的合规及内部控制委员会、督察长对本公司和本基金的合法合规性进行监督。

合规及内部控制委员会在董事会领导下,对公司固有资产和基金资产运作的合法合规性进行全面、重点的跟踪分析并提出改进方案,调整、确定公司的内部控制制度并评估其有效性,其目的是完善董事会的合规监控功能,建立良性的公司治理结构。

督察长负责合规及内部控制委员会决议的具体执行,按照中国证监会的规定和合规及内部控制委员会的授权,对公司和基金运作的合规合法性进行监督稽核。

第二层次:公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是风险控制委员会、金融工程部和监察稽核部;

风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准,划分和量化市场风险,并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

金融工程部使用数量化的风险管理系统,随时对基金投资过程中的市场风险进行独立监控,并提出具体的改进意见。

监察稽核部是公司基金运作的监察稽核部门,负责对公司和基金运作的合法合规性及内部控制制度的建立和执行情况进行监察稽核。



第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和监控。

本公司各职能部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据公司经营计划、业务规划和各部门的具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，并严格执行，将风险控制在最小范围内。

#### 4) 制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### 5) 信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证本公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### 2、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、 基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

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

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史。其前身中国人民建设银行于1954年成立，于1996年易名为中国建设银行，是中国的四大国有商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。截至2005年12月31日止，中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)总资产达人民币45,857.42亿元，客户存款达人民币40,060.46亿元，2005年实现税前利润人民币553.64亿元。截至2005年12月31日止，中国建设银行在中国内地设有13,977个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。英国《银行家》杂志2005年7月公布的世界1,000家大银行按一级资本排名中，中国建设银行列第25位，并被评选为中国“年度最佳银行”；荣获《财资》杂志2005年“中国最佳国内银行奖”；《全球托管人》杂志主办的“2005年新兴市场托管服务调查”中，获得“中国最佳托管银行”称号。

中国建设银行总行设基金托管部，基金托管部下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处和监督稽核处7个职能处室，现有员工70余人。

## 2、主要人员情况

罗中涛，基金托管部总经理，曾就职于国家统计局、建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，基金托管部副总经理，曾就职于建设银行总行人力资源部、计划部、

筹资部、国际业务部并担任领导工作,对计划、个人银行及国际业务具有丰富的经验。

### 3、基金托管业务经营情况

截止到2006年6月30日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰共11只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、华安上证180ETF、长城消费增值股票、上投摩根双息平衡混合、湘财荷银效率优选混合、交银施罗德稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华夏深圳中小企业板ETF、华富货币市场等共33只开放式证券投资基金,托管基金财产规模达881.77亿份。

## (二) 基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国建设银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。基金托管部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务

印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）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

#### 1、监督方法

基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督基金管理人各基金的投资运作，并主要采用技术系统监督和人工监督相结合的方式。

基金托管人利用自行开发的“证券投资基金托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合情况进行监督，并定期编写《基金投资运作监督报告》报送中国证监会。

基金托管人在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行人工检查监督。

#### 2、监督流程

基金托管人每日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控；如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，严密监视，及时提醒基金管理人；发现违规行为，与基金管理人进行情况核实，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

基金托管人收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资用途及费用等内容进行合法合规性监督，无误后再进行划款并记入各基金会计账目。

每双月定期根据基金投资运作比例监督情况，分别编写《基金投资运作监督报告》，对各基金投资运作进行合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面的评价，报送中国证监会。

## 五、 相关服务机构

### （一）基金管理人

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市海淀区中关村东路 99 号

法定代表人：李维雄

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

电话：010-66295888

传真：010-66295999

联系人：孙晔伟

## (二) 基金托管人

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

法定代表人：郭树清

联系人：尹东

联系电话：010-67595104

客户服务统一咨询电话：95533

网址：www.ccb.cn

## (三) 基金份额发售机构

### 1、直销机构：

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市海淀区中关村东路99号

法定代表人：李维雄

直销中心：东方基金管理有限责任公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

联系人：雷蕾

电话：010-66295888—5906

传真：010-66578700

网址：www.orient-fund.com

### 2、代销机构：

#### (1) 代销机构：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

法定代表人：郭树清

客户服务统一咨询电话：95533

网址：www.ccb.cn

(2) 代销机构：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：福州市湖东路154号中山大厦

法定代表人：高建平

联系电话：0591-87839338 - 302526

传真：0591-83317786

联系人：陈丹

客户服务电话：95561

公司网站：www.cib.com.cn

(3) 代销机构：东北证券有限责任公司

住所：长春市人民大街138-1号

办公地址：长春市自由大路1138号1007室

法定代表人：李树

电话：0431 - 5096710

传真：0431 - 5680032

联系人：高新宇

客户服务热线：0431 - 5096733

公司网站：www.nesc.cn

(4) 代销机构：广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人：王志伟

开放式基金咨询电话：020 - 87555888 - 875

开放式基金业务传真：020 - 87557985

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

(5) 代销机构：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：上海市延平路135号

法定代表人：祝幼一

电话：021 - 62580818 - 213

传真：021 - 62569400

联系人：芮敏祺

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(6) 代销机构：东方证券有限责任公司

住所：上海市浦东大道720号20楼

办公地址：上海市巨鹿路756号

法定代表人：王益民

电话：021 - 62568800 - 3003

传真：021 - 50366868

联系人：吴宇

网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(7) 代销机构：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：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021 - 53594566

传真：021 - 53858549

联系人：金芸

客户服务咨询电话：021 - 962503

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(8) 代销机构：中国银河证券有限责任公司

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：朱利

电话：010 - 66568587 - 8536

传真：010 - 66568532

联系人：郭京华

网址：www.chinastock.com.cn

(9) 代销机构：华泰证券有限责任公司

住所：南京市中山东路90号

办公地址：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 - 721

传真：025 - 84579879

联系人：张雪瑾

客户服务电话：025 - 84579897

网址：www.htsc.com.cn

(10) 代销机构：中信建投证券有限责任公司

住所：北京市东城区新中街68号

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：黎晓宏

电话：400 - 8888 - 108 ; 010 - 65186758

传真：010 - 65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(11) 代销机构：金通证券股份有限公司

住所：杭州凤起路108号国信房产大厦8-12层

办公地址：杭州凤起路108号国信房产大厦8-12层

法定代表人：应士歌

电话：0571-96598

传真：0571-85783748

联系人：何燕华

网址：www.bigsun.com.cn

(12) 代销机构：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：上海市浦东陆家嘴东路166号中国保险大厦18层

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳

网址：www.xyzq.com.cn

(13) 代销机构：国元证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551 - 2634400 - 1112

传真：0551 - 2634400 - 1171

联系人：李蔡

客户服务电话：0551 - 96888、400 - 8888 - 777

网址：www.gyzq.com.cn

(14) 代销机构：山西证券有限责任公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心

法定代表人：吴晋安

电话：0351-8686708、8686766

传真：0351-8686709

联系人：刘文康、邹连星

客户服务电话：0351-8686868

网址：www.i618.com.cn

(15) 代销机构：光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼

办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼

法定代表人：王明权

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：021-68823685

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(16) 代销机构：国信证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 层

法定代表人：何如

电话：0755 - 82130833

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

客户服务电话：800-810-8868

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(四) 注册登记机构：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市海淀区中关村东路99号

法定代表人：李维雄

电话：010 - 66295888 - 5871

传真：010 - 66578680

联系人：肖向辉

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)

(五) 律师事务所和经办律师

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京市东城区东四十条 68 号平安发展大厦 3 层

法定代表人：陶修明

联系电话：010 - 84085858

传真：010 - 84085338

联系人：钟向春

经办律师：钟向春

(六) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区东昌路 568 号

法定代表人：杨绍信 (Silas Siu Shun Yang)

联系电话：(021)6123-8888

传真：(021)6123-8800

经办注册会计师：封和平，闫琳

联系人：叶少宽

## 六、 基金的募集与基金合同的生效

(一) 本基金根据 2004 年 9 月 24 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方龙混合型开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2004]152 号)和《关于募集东方龙混合型开放式证券投资基金的确认函》(基金部函[2004]117 号)的核准，并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

(二) 本基金类型：混合型

本基金存续期间：不定期

(三) 本基金募集期为：2004 年 10 月 11 日至 2004 年 11 月 19 日

募集份额为：1130727725.99 份

有效户数为：17966 户

(四) 本基金合同生效日期为：2004 年 11 月 25 日。

## 七、 基金份额的申购与赎回

(一) 申购与赎回办理的场所

1、 本基金管理人的直销网点。

2、 经本基金管理人委托，具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即代销机构销售网点。目前的代销机构为中国建设银行、兴业银行股份有限公司、东北证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、东方证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券有

限责任公司、华泰证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、金通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国元证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国信证券有限责任公司。以上代销机构的住所同第五章所述。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。

3、投资者可通过本基金直销机构或指定的代销机构按照规定的方式进行申购或赎回。

#### (二) 申购与赎回的办理时间

1、本基金申购赎回的办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

2、基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3、若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，本基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告。

4、本基金自2004年12月20日开始正常申购；自2004年12月20日开始正常办理赎回。

#### (三) 申购限制

本基金管理人可根据市场情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下，调整首次申购的金额和赎回的份额的数量限制，调整前的3个工作日内基金管理人必须在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### (四) 申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。基金投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者交付款项，申购申请即为有效。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回的确认

当日（T日）规定时间受理的申请，基金管理人自收到基金投资者申购、赎回申请之日起2个工作日内，对该申购、赎回的有效性进行确认。正常情况下基

金投资者可从T+2工作日起直接到其办理业务的销售网点查询确认情况,打印确认单。

### 3、申购和赎回款项支付的方式和时间

基金投资者申购时,采用全额缴款方式,若资金未全额到账则视为无效申购,申购无效的款项将退回申购人。基金份额持有人赎回申请确认后,正常情况下应当自接受基金份额持有人有效赎回申请之日起7个工作日内支付赎回款项。

#### (五) 申购和赎回的数额和价格

##### 1、申购和赎回的数额、余额的处理方式

(1) 在直销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币 1,000 元,超过部分不设最低级差限制;追加申购的最低金额为人民币 1,000 元,超过 1,000 元的部分不设最低级差限制;已在直销机构销售网点有认购基金记录的基金投资者不受首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制;在代销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币 1,000 元,超过 1,000 元的部分不设最低级差限制;追加申购的最低金额为人民币 1,000 元,超过 1,000 元的部分不设最低级差限制;

(2) 在直销机构销售网点赎回的最低份额为 500 份基金份额,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致在一个销售机构的基金份额余额少于 500 份时,余额部分基金份额必须一并赎回;在代销机构销售网点赎回的最低份额为 1,000 份基金份额,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致在一个销售机构的基金份额余额少于 1,000 份时,余额部分基金份额必须一并赎回;

(3) 在直销机构,单个基金份额持有人持有本基金的最低限额为 500 份;在代销机构,单个基金份额持有人持有本基金的最低限额为 1,000 份;

(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保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产;

(5) 赎回金额的处理方式:赎回金额按实际确认的有效赎回份额,以当日基金份额净值为基准计算,保留到分,分以后的小数四舍五入,并扣除相应的费用,由此产生的误差计入基金财产。

## 2、申购份额的计算

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保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

申购份额的计算方式如下:

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购费以人民币元为单位,保留小数点后两位,小数点后两位以后舍去,由此产生的误差计入基金财产。

## 3、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中:

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

赎回费以人民币元为单位,保留小数点后两位,小数点后两位以后舍去,由此产生的误差计入基金财产。

## 4、T日基金份额净值的计算

T日基金份额净值为T日基金资产净值除以当日基金份额

(六) 不再接受或暂停接受申购和赎回申请的情况

1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

(1) 基金资产规模过大,使本基金管理人无法找到合适的投资机会,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;

(2) 本基金管理人、本基金托管人、基金代销机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分;

(3) 不可抗力的原因导致基金无法正常运作;

(4) 证券交易所交易时间非正常停市;

(5) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他暂停申购情形;

(6) 本基金管理人认为会影响其他基金份额持有人利益的申购申请。

上述(1)到(5)项为暂停申购情形,发生时本基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告;

上述(6)项为拒绝申购情形,发生时申购款项将全额退还基金投资者。

## 2、暂停赎回的条件

本基金管理人应当按时支付赎回款项,但是下列情形除外:

- (1) 因不可抗力导致本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,导致本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) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

第(1)项规定的情形消失后,本基金管理人应当及时支付赎回款项。

发生上述情形之一的,本基金管理人应当在当日报国务院证券监督管理机构备案。已接受的申请,本基金管理人应足额兑付;如暂时不能足额兑付,可兑付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未兑付部分由本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兑付,并以该开放日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项,但本基金管理人认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的,报经中国证监会批准后可以暂停接受基金投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回,基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、在暂停的情况消除时,本基金管理人应及时恢复办理申购或赎回业务。暂停期间结束,基金重新开放时,本基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天,本基金管理人将于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最新的基金份额净值。

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,本基金管理人将提前1个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露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新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,本基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次;当连续暂停时间超过两个月时,可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,本基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体连续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新的基金份额净值。

#### (七) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日净赎回申请超过基金总份额的10%的,为巨额赎回。

本基金发生巨额赎回的,基金管理人当日办理的赎回份额不得低于基金总份额的10%,对其余赎回申请可以延期办理。

##### 2、巨额赎回的处理方式

(1) 本基金发生巨额赎回的,基金管理人应对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。

基金份额持有人可以在申请赎回时选择将当日未获办理部分予以撤销。基金份额持有人未选择撤销的,基金管理人应对未办理的赎回份额,可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。

(2) 本基金发生巨额赎回并延期办理的,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式,在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定报刊及其他相关媒体上予以公告。

(3) 本基金连续发生巨额赎回,基金管理人可按基金合同的约定和招募说明书的规定,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,但延缓期限不得超过20个工作日,并应当在指定报刊及其他相关媒体上予以公告。

(八) 单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额5%的,基金管理人可以按照《证券投资基金运作管理办法》的相关规定暂停接



受赎回申请或者延缓支付。

## 八、 基金的投资

### (一) 投资目标

分享中国经济和资本市场的高速增长,为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

### (二) 投资方向

本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的重点投资对象为经过严格筛选的优势行业中的龙头企业。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的50%。

### (三) 投资策略

本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股(包括债券)选择组成。

#### 1、 决策依据及投资程序

(1) 研究部和基金管理部通过自身的研究力量,并借助外部的研究机构,对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议,讨论形成本基金的资产配置比例指导意见;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括风格管理和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,金融工程部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程做出调整。

## 2、投资管理的方法和标准

### (1) 资产配置

本基金各类资产的投资比例范围根据本基金的投资理念和投资方针决定,主要基于以下几个要素:

1) 基于对中国经济长期高速增长和中国股票市场发展的信心,本基金将主要投资于股票,以获得长期的股票投资溢价;

2) 由于目前证券市场上没有有效的衍生产品作为避险工具,在预期股市下跌的情况下,本基金将增加债券或货币市场工具的比重,用以规避股票市场下跌的系统性风险;

3) 由于日常有调整基金组合、申购新股及应付赎回的需要,在正常情况下本基金投资组合中需要保留少量现金。

在实际管理过程中,本基金管理人将依据市场的阶段性变化,通过战略资产配置和战术资产配置,动态调整三类资产的配置比例,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%。本基金的资产类别配置范围如下表所示:

**基金资产类别配置范围**

资产类别	最低比例	最高比例
股票	0%	95%
债券	0%	95%
货币市场工具	5%	100%

### (2) 积极风格管理

针对中国市场进行实证检验,本基金管理人发现:成长型投资和价值型投资作为两种不同的投资风格,在不同市场阶段有着不同表现;在牛市初期和中期,成长类股票相对表现较好,而在牛市后期或者是市场的底部区域,价值类股票相对表现较好。

因此,我们认为结合对市场时机的分析和把握,进行积极的风格管理,主动调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例可以使基金投资者获得超出市场平均水平的收益。

### (3) 个股选择

在具体的个股选择上,本基金管理人建立了一套多层次的股票筛选体系。通

过定量模型和定性分析的有机结合,充分发挥金融工程模型的客观科学性和投资研究人员的主观能动性,筛选出具有投资价值的个股。

本基金通过“股票初选”、“质量检验”、“精选龙头”和“行业优化”四个层次的股票筛选体系,层层筛选,得到最具投资价值的个股构成本基金核心股票池。

具体来看:

“股票初选”是指剔除禁止买入的股票和限制买入的股票。

“质量检验”主要从以下三个方面展开:

1) 盈利能力:用扣除非经常性损益之后的净资产收益率来衡量,在行业内按照从高到低排名;

2) 经营效率:用总资产周转率来衡量,在行业内按照从高到低排名;

3) 偿债能力:用资产负债率来衡量(金融企业除外),在行业内按照从低到高排名。

接下来,结合定量指标和定性分析从通过财务“质量检验”后的股票中挑选出优质的行业龙头组成备选股票池。其中,定量指标主要有:毛利率、扣除非经常性收益之后的净资产收益率、资产负债率、流动比率、股票每股经营性现金流、总资产周转率、来自于控股母公司的利润占税前利润的比重、关联公司之间的关联交易额占公司总收入的比重等。

最后,就是从“行业优化”的角度出发进行二次精选,确定本基金的重点投资对象。本基金评价优势行业的标准包括该行业在全球范围内的比较优势;该行业由其本身的行业结构状况、所处的生命周期以及行业政策决定的中长期的吸引力;经济周期、行业拐点所决定的该行业中短期的吸引力;最后是该行业的估值水平。

#### (4) 债券投资策略

债券投资的风险因素如果按照其对超额收益的贡献程度大小排序依次为久期、期限结构、类属配置和个债选择,我们针对每一类别的风险设计相应的管理方法而形成本基金债券组合部分的投资策略。

本基金以“理想久期”作为债券组合配置的核心,通过期限结构配置、确定类属配置、浮息债和固息债的配置、一级市场和二级市场的配置、个债选择、组合调整等策略进行债券投资。

## (5) 权证投资策略

基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于权证。

### 资产配置策略

根据股票、债券等资产类别的配置计划,为提高投资效率或避险,本基金可投资于权证,权证投资比例范围为0%~3%。

### 投资管理程序

权证投资管理程序包括研究、决策、组合构建及调整、交易、风险和绩效评估。严格的投资管理程序是避免重大风险的发生的前提。

#### A、研究

研究部负责权证投资研究工作。依据现代金融学投资理论,建立权证定价模型,结合对市场无风险利率、隐含波动率等参数的估算,评价权证的内在价值,并据此提出投资建议。

#### B、资产配置决策

在公司投资决策委员会决定的股票、债券等资产类别的配置比例范围内,基金经理根据基金组合实际情况,结合研究部提交的权证投资报告,决定权证替代投资或避险的比例。

#### C、权证组合构建

基金经理根据权证的市场交易情况,结合自身的研究判断,决定具体权证品种的投资计划,按照公司内部投资管理流程审批。

#### D、交易执行

交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括但不限于权证投资比例等。

#### E、风险与绩效评估

金融工程部事前为权证投资提供风险评估报告,事后定期和不定期为权证投资提供风险和绩效评估报告。风险评估报告包括单只权证品种本身和组合两个层面的内容。

#### F、权证投资监控与调整

基金经理根据权证投资风险与绩效评估结果并结合证券市场情况等因素,对

权证投资进行监控和调整,使之更能符合基金的投资目标。

#### (四) 业绩比较基准

1、本基金股票投资部分的业绩比较基准是新华富时 A600 风格指数,具体包括新华富时 A600 成长指数和新华富时 A600 价值指数,本基金债券部分的业绩比较基准为新华雷曼中国债券综合指数。

本基金整体业绩比较基准=新华富时 A600 成长指数 × 30% + 新华富时 A600 价值指数 × 45% + 新华雷曼中国债券综合指数 × 25%。

2、选用新华富时 A600 风格指数作为本基金的业绩比较基准,因为该指数具有以下特点:

- (1) 可投资性:即投资基准在实践中是可以实施的;
- (2) 客观性:设置上应该具有客观性;
- (3) 易于观察;
- (4) 与投资组合保持相同的风格与风险。

3、如果新华富时指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,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。

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,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。

#### (五) 投资限制

1、基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、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者债券;

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券;

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 依照法律、行政法规有关规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 2、本基金投资组合比例限制

(1) 本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不得超过本基金资产净值的10%;

(2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券, 不得超过该证券的10%;

(3) 本基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%;

(4) 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;

(5) 股票、债券和现金的投资比例应符合本基金合同规定的投资比例限制;

(6) 权证投资比例限制:

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该基金资产净值的0.5%;

本基金持有的全部权证市值不得超过该基金资产净值的3%;

本公司管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的10%;

因证券市场波动、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金组合不符合、项规定的, 基金管理人应当在十个交易日内调整完毕;

(7) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(1)、(2)、(5)、(7)项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

(六) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、处理原则:

(1) 不谋求对所投资企业的控股或者进行管理;

(2) 所有的参与均在合法合规的前提下维护基金投资者利益并谋求基金资

产的保值和增值。

## 2、方法

投资部门人员代表公司出席被投资上市公司股东会议时,应以支持以股东利益最大化为目标的企业经营管理为原则。若涉及重大决策时,如拟对上市公司公司提出的预案投反对票时,应事先召开有投资总监参加的会议讨论,并将讨论结果报备总经理办公会后,指派适当人员代表基金出席,行使决议事项,并填写会议记录。

### (七)基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2006年9月30日(财务数据未经审计)。

#### 1.基金资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占基金资产总值比例
股票	180,418,728.19	85.88%
债券	3,802,454.60	1.81%
权证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	25,368,417.67	12.08%
其他资产	499,351.59	0.23%
资产总值	210,088,952.05	100.00%

#### 2.按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	13,544,224.18	6.55%
B 采掘业	379,370.00	0.18%
C 制造业	60,022,997.40	29.05%
CO 食品、饮料	6,221,754.18	3.01%

C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	15,097,924.80	7.31%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	220,454.14	0.11%
C5 电子	3,074,513.88	1.49%
C6 金属、非金属	129,064.32	0.06%
C7 机械、设备、仪表	35,279,286.08	17.07%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	10,240,103.40	4.96%
G 信息技术业	5,245,654.60	2.54%
H 批发和零售贸易	37,462,988.20	18.13%
I 金融、保险业	29,098,193.00	14.08%
J 房地产业	20,791,964.58	10.06%
K 社会服务业	823,615.08	0.40%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	2,809,617.75	1.36%
合计	180,418,728.19	87.31%

### 3、基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	市 值 (元)	市值占净值比	数 量 (股)
1	600500	G中化	18,731,284.60	9.06%	3,263,290.00
2	600963	G岳阳	15,097,924.80	7.31%	2,096,934.00
3	600694	大商股份	13,522,718.00	6.54%	323,510.00
4	600438	G通威	12,565,233.60	6.08%	1,411,824.00
5	600036	G招行	12,425,000.00	6.01%	1,250,000.00



6	600016	G民生	12,271,413.00	5.94%	2,276,700.00
7	600967	G北创	9,614,871.80	4.65%	1,499,980.00
8	600416	G湘电	9,044,000.00	4.38%	850,000.00
9	000002	G万 科A	8,326,311.13	4.03%	1,099,909.00
10	601111	中国国航	7,160,000.00	3.46%	2,000,000.00

#### 4. 债券各券种投资组合信息披露

债券类别	债券市值(元)	市值占净值比
交易所国债投资	3,647,719.80	1.77%
银行间国债投资	0.00	0.00%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	154,734.80	0.07%
国家政策金融债券	0.00	0.00%
合计	3,802,454.60	1.84%

#### 5. 债券投资持仓前五名

债券名称	市值(元)	市值占净值比
05 国债	3,647,719.80	1.77%
招商转债	154,734.80	0.07%

#### 6. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产的构成

项目名称	项目市值(元)
交易保证金	390,741.00
应收利息	18,885.59
应收申购款	89,725.00
合计	499,351.59

(4) 本报告期内, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 本报告期内, 本基金无权证投资。

(6) 本报告期内, 本基金无资产支持证券投资。

7、开放式基金份额变动

单位: 份

期初基金份额	155,092,708.62
期间总申购份额	40,692,475.36
期间总赎回份额	20,021,003.79
期末基金份额	175,764,180.19

## 九、 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

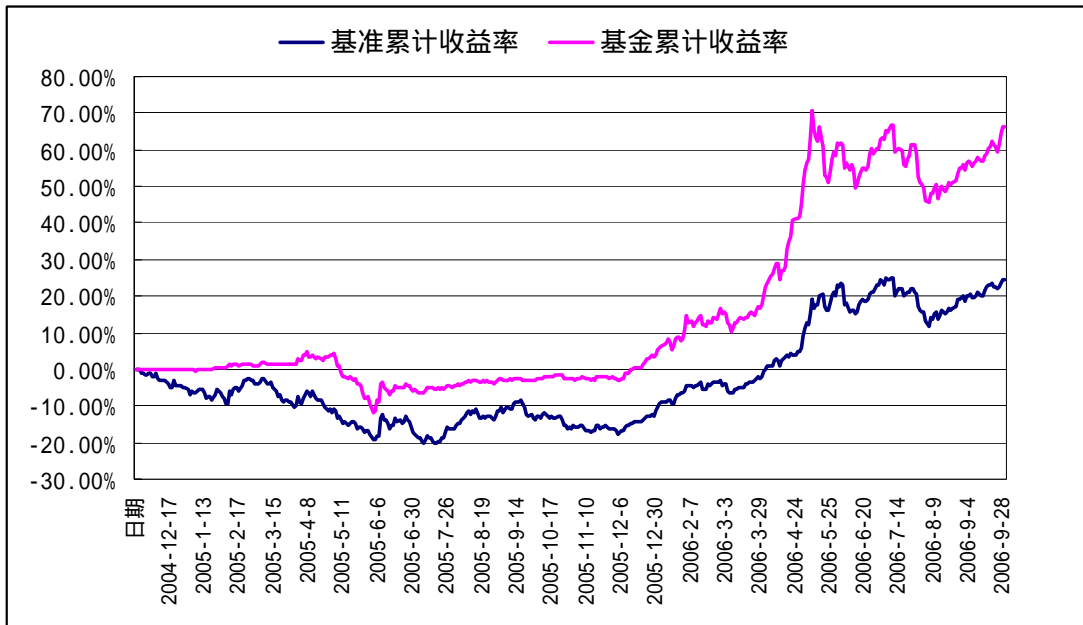
(一) 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2004/11/25-2004/12/31	0.16%	0.01%	-5.53%	0.67%	5.69%	-0.66%
2005/1/1-2005/12/31	3.07%	0.69%	-7.52%	1.04%	10.59%	-0.35%

2006/1/1-2006/9/30	60.99%	1.45%	42.68%	1.04%	18.31%	0.41%
--------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、根据《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 0%~95%、债券 0%~95%、货币市场工具 5%~100%，基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。本报告期内，本基金严格执行了《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》的相关规定。

2、本基金成立于 2004 年 11 月 25 日，截至 2006 年 9 月 30 日，本基金成立不满二年。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(三) 本着及时回报基金份额持有人的宗旨，本公司以截止至 2006 年 11 月 8 日的可分配收益为基准，向本基金份额持有人进行了第四次收益分配。该分红方案已于 2006 年 11 月 13 日公告。

1、收益分配方案为：

每 10 份基金份额派发现金红利 1.70 元。

2、收益分配时间为：

(1) 权益登记日、除息日：2006 年 11 月 17 日；

(2) 红利发放日：2006 年 11 月 20 日；

(3) 选择红利再投资的投资者,其红利将按2006年11月17日的基金份额净值转换为基金份额;

(4) 红利再投资的基金份额可赎回起始日:2006年11月21日。

3、收益分配对象:权益登记日在本公司登记在册的本基金全体份额持有人。

## 十、 基金的财产

### (一) 基金财产构成

基金财产是由基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资构成。

### (二) 基金财产的账户

基金托管人为基金设立独立的账户,本基金财产与基金托管人的资产以及其他基金的资产实行严格的分账管理。

### (三) 基金财产的保管与处分

1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益,归入基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。

4、非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

## 十一、 基金资产的估值

### (一) 估值日

自本基金合同生效(即2005年11月25日)后,每个工作日对基金财产进行估值。

### (二) 估值方法

#### 1、股票估值方法:

(1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值。

#### (2) 未上市股票的估值:

1) 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;

2) 首次发行的股票,按成本价估值。

(3) 配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

(4) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1) - (3)小项规定的方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1) - (3)小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

## 2、债券估值办法:

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值;

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘净价估值;

(3) 未上市债券按其成本价估值;

(4) 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值;

(5) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(6) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

## 3、估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

## 4、估值程序

基金日常估值由本基金管理人和本基金托管人分别处理。公开披露的基金份额净值由基金管理人完成估值后,交基金托管人复核。本基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,无误后签章返回给本基金管理人。

#### 5、估值错误的确认及处理

基金份额净值的计算,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。当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后 4 位内(含第 4 位)发生差错时,视为基金份额净值估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即公告、予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;净值错误偏差达到基金份额净值 0.5%时,基金管理人应当公告,通报基金托管人并报中国证监会备案。

基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

##### (1) 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代销机构或基金投资者自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒,则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成基金投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### (2) 差错处理原则

因基金估值错误给基金投资者造成损失的应先由基金管理人承担,基金管理人对不应由其承担的责任,有权根据过错原则,向过错人追偿,本基金合同的当事人应将按照以下约定处理。

1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,

及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的由差错责任方承担;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,由此造成或扩大的损失,由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正;

2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责;

3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责,如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失,则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方;

4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式;

5) 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产损失,由基金管理人负责向差错方追偿;

6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、本基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;

7) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、本基金合同或其他规定,基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;

8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### (3) 差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

1) 查明差错发生的原因,列明所有当事人,根据差错发生的原因确定差错责任方;

2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

4) 根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构的交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认;

因基金份额净值计算错误给基金份额持有人造成损失的处理原则、方式适用基金管理人根据相关法律法规及基金合同制定的业务规则中的相关规定;基金管理人和基金托管人之间的责任分担按照相互间签订的托管协议的相关约定

### 6、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它原因暂停营业时;

(2) 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时;

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金投资者的利益,已决定延迟估值;

(4) 如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金财产的;

(5) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 7、特殊情形的处理

(1) 本基金管理人按股票估值方法的第(4)项条款或债券估值方法的第(5)条款进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理;

(2) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,本基金管理人和本基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金财产估值错误,本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 十二、 基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

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

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### (二) 收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式。基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定，采用红利再投资方式转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；
- 3、本基金收益每年至多分配6次，每次收益分配比例不低于基金可分配收益的75%。

### (三) 收益分配方案

本基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、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、支付方式及有关手续费等内容。

### (四) 收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由本基金管理人拟定，由本基金托管人核实，在报中国证监会备案后5个工作日内公告。

### (五) 基金的业绩

## 十三、 基金的费用与税收

### (一) 基金运作相关费用

- 1、管理费；

基金管理费以基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

## 2、托管费;

基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

- 3、基金合同生效后的信息披露费用;
- 4、基金合同生效后的会计师费和律师费;
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金的证券交易费用;
- 7、银行手续费、服务费;
- 8、基金分红手续费。

9、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

上述第 3 项至第 9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后,基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付,列入当期基金费用。

## (二) 基金销售相关费用

### 1、 申购费

#### (1) 申购费率：

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。申购费率按申购金额的大小分为三档，最高不超过1.5%，具体如下表所示：

申购金额	费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)—500万元	1.2%
500万元(含)以上	1000元

#### (2) 申购份额的计算公式

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保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

申购份额的计算方式如下：

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

#### (3) 收取方式

本基金采用金额申购、前端收费的形式收取申购费用，投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

#### (4) 申购费用的使用

本基金的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

### 2、 赎回费

#### (1) 赎回费率：

赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减，即持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

投资者持有本基金365天以内的收取0.5%的赎回费率,投资者持有本基金366天以上(含366天)的收取0.25%的赎回费。如下表所示:

持有期限(日历日)	赎回费率
1天至365天	0.5%
366天(含)以上	0.25%

(2) 赎回金额的计算公式:

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

赎回总额 = 赎回份数 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

赎回总额、赎回费以人民币元为单位,保留小数点后两位,小数点后两位以后四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

(3) 收取方式:

投资者赎回申请成功后,赎回费按实际确认的有效赎回份额,以当日适用的赎回费率为基准计算。赎回费直接从赎回总额中扣除。

(4) 使用方式:

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,赎回费用的75%用于注册登记费及相关手续费,25%归基金财产。

### 3、转换费

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,投资者可以选择在本基金和东方基金管理有限责任公司管理的其他基金(如有)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将由基金管理人届时另行规定。

4、基金管理人可以从本基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人,具体办法按中国证监会有关规定执行。

### (三) 基金的税收

本基金及本基金份额持有人依据国家有关规定依法纳税。

## 十四、 基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、本基金管理人为本基金的会计责任人；
- 2、本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；本基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于3个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、本基金管理人应保留完整的会计账目、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；
- 7、本基金托管人与本基金管理人就本基金的基金财产净值、基金份额净值、报表等进行核对并确认。

### (二) 基金审计

- 1、基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务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及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得本基金管理人和本基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、本基金管理人（或本基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经本基金托管人（或本基金管理人）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5个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

## 十五、 基金的信息披露

### (一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、本基金合同及其他有关规定；

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者

能够按照本基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料；

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准；

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

(二) 公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议；

本基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

(1) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容；

本基金合同生效后，基金管理人在每六个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；

基金管理人在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(2) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件；

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

2、基金份额发售公告；

基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金募集情况；

4、基金合同生效公告；

基金管理人在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

5、基金份额上市交易公告书；

基金份额获准在证券交易所上市交易时,基金管理人在基金份额上市交易的3个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

6、基金资产净值、基金份额净值；

本基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值；基金管理人在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

7、基金份额申购、赎回价格；

基金管理人在本基金合同、本招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证基金投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

8、基金定期报告：包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告；

基金管理人在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上；基金年度报告的财务会计报告应当经过审计；

基金管理人在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

如基金合同生效不足两个月,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告；

基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和本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。

9、临时报告；

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书,

予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和本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;

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- (1) 基金份额持有人大会的召开;
- (2) 提前终止本基金合同;
- (3) 转换基金运作方式;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金募集期延长;
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- (14) 重大关联交易事项;
- (15) 基金收益分配事项;
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;
- (18) 基金改聘会计师事务所;
- (19) 变更基金份额发售机构;
- (20) 基金更换注册登记机构;
- (21) 本基金开始办理申购、赎回;
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;



- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

#### 10、澄清公告；

在本基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### 11、基金份额持有人大会决议；

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告；

召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项；

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

#### 12、中国证监会规定的其他信息。

##### (三) 信息披露事务管理

1、定期更新的招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制；

2、基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以及基金上市交易的证券交易所,供公众查阅、复制。

3、招募说明书、基金定期报告、基金资产净值公告公布后,投资者可以免费查阅。在支付工本费后可在合理时间获得上述文件的复制件或复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本定的内容与所公告的内容完全一致。

## 十六、 风险揭示

### (一) 市场风险

本基金主要投资于证券市场,而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益的不确定性。

市场风险主要包括:政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

## (二) 管理风险

1、因为开放式基金后台运作中的技术因素而产生的风险,如技术系统的故障或者差错产生的风险,这种风险来自基金管理人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等;

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;

3、因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

## (三) 流动性风险

本基金投资组合的证券可能会因为各种原因使交易的执行难度提高,买入成本或变现成本增加。

## (四) 其他风险

1、因金融市场危机、业务竞争压力可能产生的风险;

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

3、其他意外导致的风险。

## (五) 权证投资风险揭示

基金管理人本着谨慎和风险可控的原则进行权证投资,但仍具有以下风险:

### 1、 价格风险

由于权证的高杠杆性,权证价格可能会剧烈波动。权证价格与标的证券价格及波动率、利率水平、权证剩余存续期等因素高度相关;同时,权证价格可能会受权证交易活跃程度的影响。权证价格存在因上述因素变化导致的风险:

(1) 标的证券价格及波动率的下降,可能会导致权证价格的下降;

(2) 利率水平的下降,可能会导致权证价格的下降;

(3) 权证剩余存续期的缩短,可能会导致权证价格的下降。

### 2、 流动性风险

受权证规模及权证交易活跃程度的影响，权证可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

### 3、 时效性风险

权证具有一定的存续期，存续期满后权证将不具有任何价值，存在时效性风险。

### 4、 杠杆风险

由于权证的杠杆效应，权证价格的波动将远远大于其标的股票的波动而带来的风险。

### 5、 信用风险

在权证持有人行权时，存在发行人无法履约的风险。

## 十七、 基金的终止与清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会表决终止的；
- 2、因重大违法违规行为，基金合同被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人因解散、破产、撤消等事由，不能继续担任本基金的基金管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务的；
- 4、基金托管人因解散、破产、撤消等事由，不能继续担任本基金的基金托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务的；
- 5、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 6、法律法规或中国证监会允许的其他情况。

出现上述情况之一后，须依法律法规和本基金合同的规定对基金进行清算，本基金合同于中国证监会对清算结果批准并予以公告后终止。

### （二）基金财产清算小组

1、自基金合同终止之日起30个工作日内基金管理人组织成立清算财产小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继

续履行保护基金财产安全的职责；

2、基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员；

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

### (三) 基金财产清算程序

- 1、基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2、基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- 3、对基金财产进行评估；
- 4、对基金财产进行变现；
- 5、将基金清算结果报告中国证监会；
- 6、公布基金清算公告；
- 7、进行基金剩余资产的分配。

### (四) 清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金财产中支付。

### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。具体分配顺序如下：

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿基金债务；
- 4、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### (六) 基金财产清算的公告

基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报国务院证券监督管理机构备案并公

告。经中国证监会批准后3个工作日内公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由本基金托管人保存15年。

## 十八、 基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人权利及义务

1、基金管理人的权利与义务

(1) 基金管理人的权利

1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

2) 自本基金合同生效之日起，依照法律法规和本基金合同的规定独立管理基金财产，进行证券投资；

3) 根据本基金合同的规定，制定并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；

4) 依据法律法规和基金合同的规定，获得基金管理人的管理费，收取或委托收取基金投资者认购费、申购费、赎回费及其他事先公告的合理费用以及其他费用；

5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

6) 依据本基金合同及有关法律规规定监督本基金托管人，如认为本基金托管人违反了本基金合同及国家法律法规，并对基金财产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会、银行业监督管理机构，并采取其他必要措施保护基金份额持有人的利益；

7) 根据本基金合同规定销售基金份额；

8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售机构的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益；

9) 依照有关法律法规，代表本基金行使因基金投资而形成的股东权利或其他任何权利；

10) 在基金存续期内, 依据有关的法律法规和本基金合同的规定, 拒绝或暂停受理申购申请, 暂停受理赎回申请;

11) 办理基金的注册登记业务或委托其他机构代理该项业务;

12) 负责选择证券经营机构, 选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用;

13) 依据有关法律法规及本基金合同的规定决定基金收益的分配方案;

14) 依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定召集并参加基金份额持有人大会;

15) 根据国家有关规定, 在法律法规允许的前提下依法为基金融资;

16) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

1) 依法募集基金, 办理基金备案手续;

2) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

4) 配备足够的具有专业资格的人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务;

5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记业务或委托其他机构代理该项业务;

6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理、分别记账, 进行证券投资;

7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;

8) 依法接受基金托管人的监督;

9) 采取适当、合理的措施保证计算本基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定, 按有关规定计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;

10) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

11) 保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

12) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

13) 按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会;

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

17) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出;并且保证基金投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与本基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;

18) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19) 面临解散、依法被撤销、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;

20) 因过错导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;

21) 本基金托管人因过错造成基金财产损失时,应为基金向本基金托管人追偿;

22) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

23) 负责为基金聘请注册会计师和律师;

24) 有关法律法规规定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

### (1) 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规及本基金合同的规定获得基金托管费;
  - 2) 监督基金的投资运作, 如认为基金管理人违反了基金合同的有关规定, 应呈报中国证监会和银行业监督管理机构, 并采取必要措施保护基金投资者的利益。除非法律法规、基金合同及托管协议另有规定, 否则, 基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任;
  - 3) 有权对本基金管理人的违法、违规投资指令不予执行, 并向中国证监会报告;
  - 4) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;
  - 5) 依据本基金合同及有关法律规定监督本基金管理人, 如认为本基金管理人违反了本基金合同及国家法律法规, 并对基金财产或基金份额持有人利益造成重大损失的, 应呈报中国证监会、银行业监督管理机构, 并采取其它必要措施保护基金份额持有人的利益;
  - 6) 依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定召集并参加基金份额持有人大会;
  - 7) 法律法规规定的其他权利。
- (2) 基金托管人的义务
- 1) 安全保管基金财产;
  - 2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
  - 3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人的资产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;
  - 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;
  - 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同;
  - 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户, 负责办理基金投资于证券的清算交割, 执行基金管理人合法合规的投资指令, 办理基金名下的资金往来;
  - 7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定



外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
- 9) 依法办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 10) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见;
- 11) 按有关规定,保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 12) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 13) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,应及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;
- 14) 因过错导致基金财产的损失,应承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;
- 15) 基金管理人因过错造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;
- 16) 有关法律法规规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

#### (1) 基金份额持有人权利:

- 1) 分享基金财产收益;
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- 5) 出席或委派代表出席基金份额持有人大会并行使表决权;
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- 7) 因基金管理人、基金托管人、销售机构、注册登记机构的过错导致基金份额持有人损失的求偿权;
- 8) 法律法规、本基金合同约定的其他权利。

#### (2) 基金份额持有人的义务:

- 1) 遵守本基金合同;
- 2) 交纳基金认购、申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) 不从事任何有损本基金及其他基金合同当事人合法利益的活动;
- 5) 认可本基金管理人和本基金托管人订立的托管协议;
- 6) 执行生效的基金份额持有人大会决定事项;
- 7) 返还在基金交易过程中因任何原因,自本基金管理人及其代理人、本基金托管人处获得的不当得利;
- 8) 法律法规、本基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

### 1、召集事由

(1) 有以下情形之一的,按照有关的法律法规应当召开基金份额持有人大会:

- 1) 提前终止基金合同;
- 2) 与其他基金合并;
- 3) 转换基金运作方式;
- 4) 变更投资目标、范围或策略;
- 5) 变更基金份额持有人大会程序;
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- 7) 更换基金管理人、基金托管人;
- 8) 代表 10%以上(不含 10%,下同)基金份额的基金份额持有人就同一事项书面要求召集基金份额持有人大会;
- 9) 按照中国证监会的规定,对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,须召开基金份额持有人大会、变更基金合同等其他事项;
- 10) 基金合同约定的其他事项。

(2) 以下情形不需要召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低基金管理费率、基金托管费率;
- 2) 在本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- 3) 因相应的法律法规发生变动而必须对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利、义务关系发生变化;
- 5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

6) 按照法律法规和本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、召集人和召集方式

(1) 正常情况下, 基金份额持有人大会由基金管理人召集, 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集, 基金份额持有人大会的开会时间及地点由召集人选择确定。

基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集。

(2) 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的, 应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人; 基金托管人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的, 基金份额持有人可以按照《基金法》的有关规定自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的, 应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(3) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理人、基金托管人应当配合, 不得阻碍、干扰。

(4) 基金份额持有人大会按照《基金法》第七十五条的规定, 表决通过的事项, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(5) 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定。

### 3、议事程序

基金份额持有人大会由会议召集人或其委派的代表主持。

(1) 在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照下列第(5)款规定程序确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 并形成大会决议, 5日内报经中国证监会批准或备案后生效。

大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表, 在基金管理人未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权其出席会议的代表主持; 如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会, 则由出席会议的基金份额持有人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

(2) 在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前30天公布提案, 在所通知的表决截止日期第二天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议, 5日内报经中国证监会批准或备案后生效。

### 4、表决

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额有一票表决权;

(2) 基金份额持有人大会决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的半数以上通过, 但转换基金运作方式、更换基金管理人或基金托管人和提前终止基金合同, 应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过;

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

### 5、计票

#### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集, 基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与召集人授权的一名监督员共同担任监票人; 如大会由基金份额持有人自行召集, 大会主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举

三名基金份额持有人代表担任监票人；

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果；

3) 如果主持人对提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或基金份额持有人的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即进行重新清点，会议主持人应当立即重新清点。会议主持人应公布重新清点结果，重新清点仅限一次。

#### (2) 通讯方式开会

由大会召集人授权的两名监督员在基金托管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。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

### (三) 基金合同解除和终止

#### 1、解除和终止的事由

(1) 基金份额持有人大会表决终止的；

(2) 因重大违法违规行为，基金合同被中国证监会责令终止的；

(3) 基金管理人因解散、破产、撤消等事由，不能继续担任本基金的基金管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务的；

(4) 基金托管人因解散、破产、撤消等事由，不能继续担任本基金的基金托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务的；

(5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

(6) 法律法规或中国证监会允许的其他情况。

#### 2、解除和终止的程序

出现上述情况之一后，须依法律法规和本基金合同的规定对基金财产进行清算，本基金合同于中国证监会对清算结果批准并予以公告后终止。

3、基金财产清算方式依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。具体分配顺序如下：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (四) 争议解决方式

1、因本基金合同产生或与之相关的争议，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，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，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议涉及基金管理人和/或基金托管人的，争议处理期间，基金管理人和/或基金托管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托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

2、解决上述争端的依据为中华人民共和国有关法律法规。

#### (五) 基金合同的存放和获得方式

基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同登载在网站上。

基金合同可印制成册并对外公开散发或供基金投资者在有关场所查阅，但应以基金合同正本为准。

## 十九、 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市海淀区中关村东路99号

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

法定代表人：李维雄

总经理：程红

成立日期：2004年6月11日

注册资本：1亿元人民币

经营范围：发起设立基金；基金管理；法律法规允许和中国证监会核准的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：1100001704226

## 2、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)

注册地址：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：100032

法定代表人：郭树清

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：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

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) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

(1) 基金托管人根据法律法规和基金合同的规定，对本基金的投资范围、基金财产的投资组合、所托管的本基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算等事项进行监督和核查。

(2) 基金托管人发现上述事项基金管理人的行为违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及

纠正期限,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。

(3)基金托管人发现基金管理人上述事项有重大违规行为,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。

## 2、基金管理人 对基金托管人的业务监督、核查

(1)根据法律法规和基金合同的规定,基金管理人 对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金财产实行分账管理、擅自动用基金财产等行为进行监督和核查。

(2)基金管理人发现基金托管人的行为违反法律法规和基金合同的规定,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在下一工作日前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期限,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。

(3)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。

## 3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本托管协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由,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,情节严重或经监督方提出警告仍不改正的,监督方应报告中国证监会。

### (三)基金财产保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1)基金托管人应安全保管基金的财产。

(2)基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户,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和独立。

(3)除证券交易清算资金外,基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产,如有特殊情况双方可另行协商。

(4)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,由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

(5) 基金托管人应当设有专门的基金托管部门,取得基金从业资格的专职人员达到法定人数,有安全保管基金财产的条件,有安全高效的清算、交割系统,有符合要求的营业场所、安全防范设施和与基金托管业务有关的其他设施,有完善的内部稽核监控制度和风险控制制度。

(6) 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。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“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,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中,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) 若基金未达到成立条件,由基金管理人按规定办理退款事宜。

## 3、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和使用。

(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本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财产支付。

## 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公

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,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本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,管理和运用由基金管理人负责。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

(1) 基金合同生效后,由基金管理人向基金托管人提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新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。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券的保管按照实物证券相关规定办理。

#### 8、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原件分别由基金托管人、基金管理人保管。重大合同包括基金合同、托管协议。

#### (四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,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。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

#### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

#### (五) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金注册登记机构负责编制和保管基金份额持有人名册。基金合同生效日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日的基金份额持有人名册,由基金注册登记机构负责编制。

基金管理人对其对基金份额持有人名册的保管,按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### (七) 争议处理和适用法律

1、因本合同产生或与之相关的争议,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,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,仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

争议处理期间,基金管理人和/或基金托管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。

2、解决上述争端的依据为中华人民共和国有关法律法规。

#### (八) 托管协议的修改与终止

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。修改后的新协议,报中国证监会备案后生效,须经证监会批准的,经其批准后生效。

发生以下情况,本托管协议终止:

1. 基金或本基金合同终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

## 二十、 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内

容,基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

#### (一) 资料寄送

##### 1、账户卡及开户确认书

在开户确认后的一星期内向基金份额持有人寄送账户卡及开户确认书。

##### 2、基金投资者对账单

基金份额持有人对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单每季度提供,在每季结束后的7个工作日内向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送,年度对账单在每年度结束后7个工作日内对所有基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送。

##### 3、其他相关的信息资料

#### (二) 红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,如果基金份额持有人选择将所获红利再投资于本基金,注册登记机构将其所获红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

#### (三) 定期定额投资业务

本基金已开展定期定额投资业务,详情可登陆本公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 查阅本公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告。

为方便投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本公司将酌情增加本基金定期定额投资业务代销机构。

#### (四) 基金转换

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,基金投资者可以选择在本基金和本公司管理的其他基金(如有)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。

#### (五) 在线服务

1、基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理(或投资顾问)的定期在线交流服务。

## 2、网上交易业务

本基金已开通网上交易业务,个人投资者可通过本公司网上交易平台办理本基金的开户、申购、赎回等各项业务,本公司在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动,个人投资者通过本公司网上交易平台办理本基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆本公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 查阅本公司旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本公司将酌情丰富网上交易渠道。

### (六) 资讯服务

1、投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打东方基金管理有限责任公司如下电话:

电话呼叫中心:010-66578578,该电话可转人工座席。

传真:010-66578700

### 2、互联网站

公司网址:[http:// www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)

电子信箱: [services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com)

## 二十一、 其他应披露事项

(一)在本基金存续期内,本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化,职能也会相应地做出调整,但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

(二)基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定(包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充)。上述规则由本基金管理人制定,并由其解释与修改,但规则的修改若实质性地修改了本基金合同,应召开基金份额持有人大会,对基金合同的修改达成协议。本基金托管人不受《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的限制。

(三)本《招募说明书》将按中国证监会有关规定定期进行更新;《招募说明书》解释与本基金基金合同不一致时,以本基金基金合同为准。

(四)从2006年6月21日到本次《招募说明书(更新)》截止日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
本基金资产净值公告	2006-07-03
本基金招募说明书(更新)摘要(2006年第1号)	2006-07-07
本基金2006年第2季度报告	2006-07-21
本基金2006年半年度报告	2006-08-29
本公司旗下基金开通网上交易业务公告	2006-09-21
本公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告	2006-10-13
本公司迁址公告	2006-10-17
本基金2006年第3季度报告	2006-10-25
本基金第四次分红公告	2006-11-13
本公司关于增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2006-11-20
关于本公司旗下基金开展促销活动的公告	2006-11-22
关于调整东方龙混合型开放式证券投资基金直销中心最低申购和赎回起点的公告	2006-12-14

## 二十二、 招募说明书的存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十三、 备查文件

以下备查文件分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制。

- (一)中国证监会批准东方龙混合型开放式证券投资基金募集的文件
- (二)《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》
- (三)东方基金管理有限责任公司代理销售协议
- (四)托管协议
- (五)法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批件和营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (八)中国证监会要求的其他文件

东方基金管理有限责任公司

2007年1月5日