（上接A27版）

第九部分　基金的投资

一、投资目标
本基金面点投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、资产支持证券、权证、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，投资于产业升级和消费升级主题的证券不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

二、投资策略

（一）大类资产配置

本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。

（二）股票投资策略

本基金所言的“双擎升级”是指中国经济和社会正面临的产业升级和消费升级，其中蕴含着巨大而又丰富的投资机会。本基金股票投资将重点挖掘中国经济产业升级和消费升级过程中受益的行业和个股，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略，挖掘中国经济和社会发展过程中的投资机会。

1、主题挖掘

（1）产业升级

当前中国经济和社会发展的几个明显趋势主要包括有：经济结构正不断优化、新兴产业、消费环节对经济增长的贡献日趋增大，经济增长动力正逐步由生产要素和投资驱动向技术创新驱动发展；新型城镇化、人口结构变化等社会变迁正不断推动着产业变迁；经济全球化市场的趋势日趋增强。这些发展趋势不断推动着产业的发展和升级，催含着巨大的投资机会。

本基金将重点关注符合上述中国经济和社会发展趋势的产业进行布局，重点关注的领域包括：受益于政府政策扶持，有望成为经济增长新引擎的战略新兴产业，如节能环保、信息技术、生物医药、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车、新兴消费产业等；受益于技术升级、信息化改造、商业模式变革、市场机制、组织结构革新等因素而产生如生产成本下降、生产效率提高、市场空间扩展、产品结构和品质提升等影响，进而带来显著经济效益的传统产业上市公司，如随国家“一带一路”战略实施而受益的基建相关产业上市公司，因使用新的生产技术或者先进生产设备而显著降低生产成本或者提高生产效率的传统制造业上市公司，因互联网赋能而打开内销市场或者提升品牌影响力的外资相关产业上市公司，因销售模式或组织结构革新而获得新动力的零售行业上市公司等等。

（2）消费升级

随着中国经济的发展和财富的增长，人民对物质、文化生活水平的要求越来越高。人民日益增长对美好生活的需求，蕴含着丰富而又巨大的投资机会。本基金将重点关注消费升级过程中受益的行业和个股，重点关注的领域包括：如食品饮料、文体娱乐、医疗健康、金融地产、服饰、交通工具等行业。

本基金将持续跟踪研究、比较纵横新、不断挖掘产业升级和消费升级过程中的投资机会。

2、行业配置策略

本基金在所选产业中选择点考察相关行业在产业链上的影响力，对上下游的议价能力、市场规模和利润占比，分析行业内产品的需求空间和成长速度、行业的技术发展、需求变化和创新程度，以及行业在国内发展动态等因素，判断行业生命周期和发展前景；分析行业的技术壁垒和进入壁垒、行业内企业的财务状况以及商权模式等因素，判断行业的竞争环境；判断各行业相对投资价值与投资时机，从中挑选出具有市场空间较广、成长性较高的行业进行配置。

3、股票选股

本基金通过定性和定量分析方法及其它投资分析工具，自下而上方式精选具有良好成长性和投资潜力的股票构建股票投资组合。

（1）定性分析

从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行进一步的精选。

①持续成长性的分析：通过对上市公司主产品、技术、市场、经营模式等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。

②在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、开拓市场、进而创造利润增长的能力。

③公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。

（2）定量分析

在定性分析的基础上，本基金将主要运用财务报表分析与估值分析方法进行个股的定量分析。财务分析方面，本基金采用主营业务收入增长率、主营业务利润率、净资产回报率（ROE）以及经营现金净流量，作为评价上市公司投资价值的核心财务指标。估值分析方面，本基金将采用（PE）/（PE）为估值分析的主要指标来考察上市公司投资价值。

（三）债券投资策略

本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。

1、久期配置策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断应付利率波动风险、货币政策由内向宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断；结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

2、类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定其有最优风险收益特征的资产组合。

3、个券选择策略

对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，根据发展前用利差具有相对优势的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

4、可转换投资策略

可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，另在信用风险、利率风险可控的情况下，以期获取较高的权益类收益。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券是一种以基础资产所产生的现金流为偿付支持，通过结构化设计，将预期现金流进行再分配，以期在风险可控的前提下获取较高收益的证券品种。本基金将在充分揭示风险、收益特征的基础上，以期获取较高收益为目标，在综合考虑证券的流动性、久期、信用风险、提前偿付风险等因素的基础上，对资产支持证券进行投资。

6、股指期货投资策略

股指期货具有杠杆交易、双向交易、交易成本较低、流动性较高、卖空便利等特点，是对现货市场进行有效对冲的工具。本基金将在充分考虑股指期货的流动性、基差、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑现货市场的系统性风险、个股的风险特征、股指期货的定价特征、股指期货的流动性、交易成本、卖空便利等因素的基础上，对股指期货进行有效对冲。

7、国债期货投资策略

国债期货具有杠杆交易、双向交易、交易成本较低、流动性较高、卖空便利等特点，是对现货市场进行有效对冲的工具。本基金将在充分考虑国债期货的流动性、基差、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑现货市场的系统性风险、个券的风险特征、国债期货的定价特征、国债期货的流动性、交易成本、卖空便利等因素的基础上，对国债期货进行有效对冲。

8、融资融券投资策略

本基金将在充分考虑融资融券业务的杠杆效应、流动性、成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑融资融券业务的杠杆效应、流动性、成本、卖空便利等因素的基础上，对融资融券进行投资。

9、股票期权投资策略

股票期权具有杠杆交易、双向交易、交易成本较低、流动性较高、卖空便利等特点，是对现货市场进行有效对冲的工具。本基金将在充分考虑股票期权的流动性、基差、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑股票期权的流动性、基差、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，对股票期权进行有效对冲。

10、证券借贷业务投资策略

证券借贷业务是指证券持有人将其证券出借给他人，并与其约定未来归还证券的权利义务，证券借入人则向证券持有人提供证券担保物，并与其约定未来返还证券及证券孳息的权利义务，并支付证券借贷费用的一种证券交易行为。本基金将在充分考虑证券借贷业务的杠杆效应、流动性、成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑证券借贷业务的杠杆效应、流动性、成本、卖空便利等因素的基础上，对证券借贷业务进行有效对冲。

11、其他投资策略

本基金将在充分考虑其他投资品种的流动性、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，在风险可控的前提下，以期获取较高收益为目标，在综合考虑其他投资品种的流动性、杠杆水平、保证金水平、交易成本、卖空便利等因素的基础上，对其他投资品种进行有效对冲。

三、基金投资限制

本基金的投资组合应遵守下列限制：

1、股票投资占基金资产的比例为60%-95%，投资于产业升级和消费升级主题的证券不低于非现金基金资产的80%；

2、每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

3、基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

4、基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%；

5、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

6、基金管理人管理的全部开放式基金持有一家公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的15%；管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%；

7、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

8、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

9、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

10、本基金持有同一股票的权证，其行权后所获得的股票，不超过该股票可流通部分的10%；

11、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不超过该资产支持证券规模的10%；

12、本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

14、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

15、本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

16、本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

17、本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

18、本基金参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：

在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；本基金所持有的国债期货合约价值与有价证券市值之和（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

19）基金公司不得超过基金净资产的140%。

20）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

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

除投资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基合同生效之日起开始。

（3）法规允许的基金投资比例调整原则

除上述第（2）款第1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12、20）小项规定的情形外，由于证券、期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因致使基金投资组合不符合上述约定的比例，在不限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规和基金合同另有规定的，从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

（4）其他投资限制

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人投资运转指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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立即核对确认并以书面形式回基金管理人发出回函。在限期内，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，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人应当在中国证监会、基金托管人的监督下进行基金清算。

2、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》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：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。

5、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案确认并公告；

（7）对基金财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，基金财产清算小组可根据流通受限证券的处理情况适当延长清算期限，并提前公告。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（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、交纳所欠税款并清偿基金债务后，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

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案并确认后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

第十八部分　基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人简况

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室—49848（集中办公区）

法定代表人：孙柯明

设立日期：2003年8月5日

批准设立机关及批准设立文号：证监基金字[2003]91号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币1.2688亿元

存续期限：持续经营

联系电话：020-83936666

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金的投资运作；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）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；

（5）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，进行独立核算；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）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；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

（13）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基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（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或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金会计账簿、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并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、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和其他有关监管机构，并通知基金管理人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金管理人行使赔偿或赔偿金的权利；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）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；（24）基金在募集期间未能达到基金的备案条件，（基金合同）不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立开保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

（四）　基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应立即通知基金管理人，并根据必要情况召集基金份额持有人大会讨论的其他事项。

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、基金证券清算专用账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）按照《基金合同》的规定，根据基金管理人的指令或有关当事人的书面指令对基金财产实施安全保管、投资监督、基本账户开户、清算交割、资金划拨、会计核算、估值、现金管理、证券投资工具的保值增值、证券投资工具的估值、法律法规允许的其他投资运作相关事项的独立复核、办理基金名义的开户、销户等手续；

（6）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得向他人泄露；

（7）按照《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，及时报告中国证监会和其他有关监管机构，并通知基金管理人；

（8）国家有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定赋予基金托管人的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）安全保管基金财产；

（2）按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（3）保管基金管理人为基金开立的证券账户、证券清算专用账户、基金银行存款账户及基金财产的其他账户的账户资料；

（4）按照有关法律、法规和《基金合同》的规定，为基金开设证券账户、证券清算专用账户、基金银行存款账户及基金财产的其他账户；

（5）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与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行独立核算；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）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；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的规定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（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或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金会计账簿、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并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、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和其他有关监管机构，并通知基金管理人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金管理人行使赔偿或赔偿金的权利；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）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；（24）基金在募集期间未能达到基金的备案条件，（基金合同）不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立开保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

（四）　基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应立即通知基金管理人，并根据必要情况召集基金份额持有人大会讨论的其他事项。

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、基金证券清算专用账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）按照《基金合同》的规定，根据基金管理人的指令或有关当事人的书面指令对基金财产实施安全保管、投资监督、基本账户开户、清算交割、资金划拨、会计核算、估值、现金管理、证券投资工具的保值增值、证券投资工具的估值、法律法规允许的其他投资运作相关事项的独立复核、办理基金名义的开户、销户等手续；

（6）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得向他人泄露；

（7）按照《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，及时报告中国证监会和其他有关监管机构，并通知基金管理人；

（8）国家有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定赋予基金托管人的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）安全保管基金财产；

（2）按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令及时办理清算、交割事宜；

（3）保管基金管理人为基金开立的证券账户、证券清算专用账户、基金银行存款账户及基金财产的其他账户的账户资料；

（4）按照有关法律、法规和《基金合同》的规定，为基金开设证券账户、证券清算专用账户、基金银行存款账户及基金财产的其他账户；

（5）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，进行独立核算；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）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；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的规定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（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或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）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；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人行使赔偿或赔偿金的权利。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资运作监督与行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、资产支持证券、权证、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；但须与基金投资人协商一致方可纳入投资监督范围。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，投资于产业升级和消费升级主题的证券不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定的，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规进行合理地调整投资范围。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1）股票投资占基金资产的比例为60%-95%，投资于产业升级和消费升级主题的证券不低于非现金基金资产的80%；

2）每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

4）本基金管理人管理的目前本基金托管人托管的：全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的15%；全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%。

5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

6）本基金管理人管理的目前本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

8）本基金在任何交易日买入的同一股票的权证，其行权后所获得的股票，不超过该股票可流通部分的10%；

9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

11）本基金管理人管理的目前本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券规模的10%；

12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

13）基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

15）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

16）本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

17）本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

18）本基金参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：

在任何交易日日终，