

# 泰达宏利风险预算混合型证券投资 基金更新招募说明书

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

## 重要提示

泰达宏利风险预算混合型证券投资基金于 2004 年 12 月 27 日经中国证监会证监基金字【2004】216 号文核准募集，基金合同于 2005 年 4 月 5 日正式生效。

本基金管理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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书正文。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 10 月 5 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日，已经托管银行复核，财务数据未经审计。

## 目 录

|                          |     |
|--------------------------|-----|
| 一、绪言 .....               | 4   |
| 二、释义 .....               | 5   |
| 三、基金管理人 .....            | 8   |
| 四、基金托管人 .....            | 17  |
| 五、相关服务机构 .....           | 20  |
| 六、基金份额的申购、赎回和基金间转换 ..... | 46  |
| 七、基金的投资 .....            | 52  |
| 八、基金的业绩 .....            | 62  |
| 九、基金的财产 .....            | 63  |
| 十、基金资产的估值 .....          | 65  |
| 十一、基金的收益和分配 .....        | 70  |
| 十二、基金的费用与税收 .....        | 71  |
| 十三、基金的会计与 .....          | 73  |
| 十四、基金的信息披露 .....         | 74  |
| 十五、风险揭示 .....            | 77  |
| 十六、基金合同的终止和基金财产的清算 ..... | 78  |
| 十七、基金合同内容摘要 .....        | 80  |
| 十八、基金托管协议的内容摘要 .....     | 93  |
| 十九、基金份额持有人的服务 .....      | 100 |
| 二十、其他应披露事项 .....         | 102 |
| 二十一、招募说明书存放及查阅方式 .....   | 105 |
| 二十二、备查文件 .....           | 105 |

## 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》）、《公开募集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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）等有关法律法规以及《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、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。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理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。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本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。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：指泰达宏利风险预算混合型证券投资基金

本基金合同或基金合同：指《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金合同》

《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过的《中华人民共和国证券法》及立法机关对其所作的修订；

《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经中华人民共和国第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过的自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；

《信托法》：指《中华人民共和国信托法》

《运作办法》：指 2014 年 7 月 7 日由中国证监会公布并于 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关不时做出的修订

《销售办法》：指 2013 年 2 月 17 日由中国证监会第二十八次主席办公会议通过的自 2013 年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；

《信息披露办法》：指 2004 年 6 月 8 日中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露管理办法》；

招募说明书：指《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金招募说明书》

更新招募说明书：指本基金合同生效后依法对招募说明书定期更新的文件

发售公告：指《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金份额发售公告》

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

中国银监会：指中国银行业监督管理委员会

元：指人民币元

本基金合同当事人：指受本基金合同约束，根据本基金合同享有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

基金管理人：指泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：指交通银行股份有限公司（以下简称交通银行）

基金份额持有人：指依法并依据本基金合同及相关法律文件合法取得并持有本基金份额的投资者

**注册登记业务：**指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易确认、清算和结算、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泰达宏利基金管理有限公司或接受泰达宏利基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记业务的机构

**代销机构：**指符合法律法规及其他有关规定要求的条件并与本基金管理人签订了销售服务协议，代为办理本基金销售服务业务的机构

**销售机构：**指泰达宏利基金管理有限公司和代销机构

**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

**机构投资者：**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企业法人、社会团体、其它组织

**基金合同的生效：**指本基金募集完成，符合本基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，本基金合同生效

**基金合同的终止：**指法律法规及有关规定规定的或者本基金合同规定的基金终止事由出现时，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同

**募集期限：**指本基金份额发售公告及相关公告中规定的本基金份额的发售时间段，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月

**存续期：**指本基金合同生效日至终止日之间的不定期期限

**工作日：**指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

**T 日：**指销售机构受理投资者对本基金的认购、申购、赎回、基金间转换或其他业务的申请日

**T+n 日：**指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

**认购：**指投资者在本基金募集期内申请购买本基金份额的行为

**申购：**指投资者在本基金合同生效后申请购买本基金份额的行为

**赎回：**指本基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求基金管理人购回其所持基金份额的行为

**基金间转换：**指在本基金存续期间，本基金份额持有人将其持有的本基金份额转换为本基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为

**巨额赎回：**指基金单个开放日，本基金赎回申请份额总数（包括基金间转换导致的本基金减少的份额）扣除本基金申购份额和其它基金转换为本基金份额后的总余额超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形

**投资指令：**指基金管理人在运用本基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令

**基金收益：**指本基金投资所得红利、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：**指本基金购买的各种证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他财产的价值总和

**基金资产净值：**指本基金资产总值减去本基金负债后的价值

**基金资产估值：**指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的  
的行为

**基金账户：**指基金注册登记机构为投资者开立的记录其持有本基金的基金份额及其变更情况的账户

**指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

**不可抗力：**指本基金托管人、基金管理人签署本基金合同之日后发生的本基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，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、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

设立日期：2002 年 6 月 6 日

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577808

信息披露联系人：陈沛

注册资本：1.8 亿元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前，公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券



型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金在内的四十多只证券投资基金。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、经济学硕士学位。1988年至2001年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长；2001年至2003年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人；2003年至2014年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，2015年4月任公司副总经理，2015年8月起任公司总经理。

杨雪屏女士，董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995年至2003年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑；2003年至2012年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科；自2012年至今就职于天津市泰达国际控股（集团）有限公司，曾担任资产管理部高级项目经理，现任综合办公室副主任。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989年任职天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作；1997年任职天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001年任职天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位。现为宏利行

政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于 2007 年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013 年 6 月至 2015 年 4 月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基美隆大学，持有数学及管理科学理学学士学位，现为宏利资产管理（亚洲）总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理（香港）有限公司董事，掌握亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区（香港除外）的投资事务。2001 年至 2004 年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于 2001 年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十多年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990 年获夏威夷大学经济学博士学位。1984 年至 1998 年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自 2007 年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，中国政法大学法学硕士学位、民商法学博士学位。1990 年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托

业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士，独立董事，任期始于 2014 年 6 月 20 日。毕业于南开大学法律系，获得法学学士和法学硕士学位。1992 年 10 月，与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所，现任该律所副主任，正高级律师，具有 22 年法律实务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

何自力先生，独立董事，1982 年毕业于南开大学，经济学博士。1975 年至 1978 年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工；1982 年至 1985 年，于宁夏自治区党校从事教学和科研工作；1988 年至今任职于南开大学，历任经济学系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津经济学会副会长；2002 年 1 月至 7 月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

## 2、监事会成员

许宁先生，监事长。毕业于南开大学，经济学硕士。1991 年至 2008 年任职于天津市劳动和社会保障局；2008 年加入天津市泰达国际控股（集团）有限公司，担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998 年先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005 年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北亚投资负责人。

王泉先生，职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理、运营副总监兼基金运营部总经理，自 2014 年 10 月起担任运营总监。

邓艺颖女士，职工监事。金融学硕士，2004 年 5 月至 2005 年 4 月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部；2005 年 4 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部副总监、投资副总监兼研究部总监，现任投资副总监兼投资部总监；具备 11 年基金从业经验，11 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

## 3、总经理及其他高级管理人员

弓劲梅女士，董事长。简历同上。

刘建先生，总经理。简历同上。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位，北京大学国家发展研究院 EMBA。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，

从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监；2007年1月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生，副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学，获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998年8月至2001年4月，先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师；2001年5月至2008年2月，任保德信投信股票投资主管；2008年2月至2008年8月，就职于复华投信香港资产管理公司，担任执行长；2008年8月至2015年10月，就职于宏利资产管理有限公司，担任台湾地区投资主管；2015年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监，2015年12月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

丁宇佳女士，理学学士；2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理；2015年3月26日起担任泰达宏利货币市场基金基金经理；2015年6月11日至今担任泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）（原泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金）基金经理；2015年6月11日至今担任泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年6月16日至今担任泰达宏利淘利债券型证券投资基金基金经理；2015年6月16日至今担任泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金经理；2015年6月16日起至今担任泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年6月18日起至今担任泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年11月4日起至今担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理；2016年9月26日至今担任本基金基金经理；2016年9月26日起至今担任泰达宏利集利债券型证券投资基金基金经理；2016年9月26日起至今担任泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年9月29日至今担任泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具备8年基金从业经验，8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

刘欣先生，理学硕士，2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司，2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加入泰达宏利基金管

理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员，金融工程部副总经理，现担任金融工程部总经理。2014年1月3日至今担任泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金经理；2015年2月13日至今担任泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年11月17日至今担任泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；2016年2月23日至今担任泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年9月26日起至今担任本基金基金经理；2016年9月26日起至今担任泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金经理。具备9年基金从业经验，9年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：梁钧先生，2005年2月至2007年3月管理本基金；康赛波先生，2005年2月至2006年12月管理本基金；彭泳先生，2007年3月至2008年3月管理本基金；许杰先生，2006年12月至2011年9月管理本基金；沈毅先生，2008年3月至2012年9月管理本基金；吴俊峰先生，2011年9月至2014年9月管理本基金；陈晓舜先生，2014年9月至2015年6月管理本基金；胡振仓先生，2015年3月至2015年6月管理本基金；卓若伟先生，2015年6月至2016年9月管理本基金；李坤元女士，2015年6月至2016年9月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会由公司总经理刘建、副总经理兼投资总监王彦杰、投资副总监兼投资部总监邓艺颖、金融工程部门负责人戴洁、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项。

- 1) 固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。
- 2) 权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、庄腾飞表决。
- 3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述成员之间不存在近亲属关系。

#### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、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；
- 11、以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）承销证券；
- （4）将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- （5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- （6）依照法律、行政法规的有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、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、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）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；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉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、受雇人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) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

(3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

### 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控

制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。董事会下设合规控制委员会、资格审查委员会和薪酬委员会；

督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向合规控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

监察稽核部与风险管理部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织 and 授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，



能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：汤嵩彦

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2015年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第17位，较上年上升2位；根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行

营业收入位列第190位，较上年上升27位。

截至2016年6月30日，交通银行资产总额为人民币79,563.22亿元。2016年1-6月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币376.61亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## (二) 主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

## (三) 基金托管业务经营情况

截至2016年6月30日，交通银行共托管证券投资基金175只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投

资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合

理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规记录，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五、相关服务机构

### （一）直销机构

泰达宏利基金管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮编：100033

传真：010-66577666

客户服务电话：400-698-8888（免长话费）或010-66555662

联系人：于贺

联系电话：010-66577619、010-66577617

网址：<http://www.mfcteda.com>

网上直销网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、中国银行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、广发银行卡和汇付天下“天天盈”、快钱支付账户。

泰达宏利微信公众账号：mfcteda\_BJ, 支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下“天天盈”账户和快钱支付账户。

## （二）代销机构

### 1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

银行网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### 3) 中国建设银行股份有限公司

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

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

**4) 中国农业银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

**5) 中国银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

**6) 招商银行股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

**7) 中国邮政储蓄银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

#### 8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

#### 9) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

客服电话：95558

网址：<http://bank.ecitic.com>

#### 10) 东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国锋

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：陈幸

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.cn

#### 11) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

#### 12) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：www.cbhb.com.cn

#### 13) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340



传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

#### 14) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

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

#### 15) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

#### 16) 天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号

办公地址：天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人：王金龙

客户服务热线：4006-960296

公司网站：[www.bank-of-tianjin.com](http://www.bank-of-tianjin.com)

#### 17) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699

公司网站：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

#### 18) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021- 68865680

公司网站：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

#### 19) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

传真：022-28451892

电子邮箱：[hutt@bhzq.com](mailto:hutt@bhzq.com)

客户服务电话：4006515988

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

#### 20) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：陈有安

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568450

联系人：宋明

公司网站：www.chinastock.com.cn

## 21) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

## 22) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

## 23) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：芮敏祺

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

#### 24) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

全国免费业务咨询电话：95511

传真：0755-82400862

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

#### 25) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：胡月茹

公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

#### 26) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

公司网站：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

#### 27) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

## 28) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

## 29) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

## 30) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

客服电话：400-620-8888

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

公司网站：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

### 31) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户服务电话：95597

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

### 32) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525 400-888-8788 101-089-98

传真：021-22169134

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

### 33) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

客户服务电话：400-698-9898

公司网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

### 34) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

### 35) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

### 36) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：潘月

联系电话：025-52310569

客户服务电话：400-828-5888

公司网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

### 37) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

### 38) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553，400-8888-001

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

### 39) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人：邱三发

客服电话：020-961303

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn



#### 40) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

传真：0591-87383610

联系人：张宗锐

公司网站：www.hfzq.com.cn

#### 41) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

公司网站：www.guosen.com.cn

#### 42) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：4008-888-228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

#### 43) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：400-888-8128

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

#### 44) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

#### 45) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：95531, 400-888-8588

#### 46) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

#### 47) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

#### 48) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

#### 49) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

#### 50) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

公司网址：www.msq.com

客服热线：400-619-8888

#### 51) 国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

客服电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

#### 52) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

公司网址：www.citics.com

客服热线：95558

#### 53) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：陈宏

公司网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

客服热线：400-911-2233

#### 54) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7、8 层，深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：吴永良

公司网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

客服热线：400-102-2011

#### 55) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 20 层

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

公司网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

客服热线：95548

#### 56) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

公司网址：[www.hongtastock.com](http://www.hongtastock.com)

客服热线：400-871-8880

#### 57) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦 5 楼

法定代表人：余维佳

公司网址：www.swsc.com.cn

客服热线：400-809-6096

#### 58) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

公司网址：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

#### 59) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号8楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服热线：400-821-5399

#### 60) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

#### 61) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

公司网址：www.ehowbuy.com

客服热线：400-700-9665

#### 62) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：杭州市西湖区天目山路 266 号黄龙时代广场 B 座支付宝

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

#### 63) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

#### 64) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-021-20691942

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

**65) 和讯信息科技有限公司**

注册地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835817

传真号码：021-20835885

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

**66) 北京展恒基金销售股份有限公司**

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

公司网址：www.myfund.com

**67) 浙江同花顺基金销售有限公司**

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

**68) 一路财富（北京）信息科技有限公司**

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀



客户服务热线：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

**69) 上海汇付金融服务有限公司**

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客户服务热线：400-820-2819

公司网址：https://tty.chinapnr.com

**70) 上海陆金所资产管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客户服务热线：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

**71) 北京恒天明泽基金销售有限公司**

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层 2302#

法定代表人：李悦

客户服务热线：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

**72) 大泰金石投资管理有限公司**

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客户服务热线：400-928-2266

公司网址：<http://www.dtfortune.com>

**73) 浙江金观诚财富管理有限公司**

注册地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客户服务热线：400-068-0058

公司网址：<http://www.jincheng-fund.com>

**74) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 17 层

法定代表人：杨懿

客户服务热线：400-166-1188

公司网址：<http://money.jrj.com.cn>

**75) 上海联泰资产管理有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客户服务热线：400-046-6788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

**76) 北京广源达信投资管理有限公司**

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

公司网址：<http://www.niuguwang.com>

客服热线：400-623-6060

**77) 武汉市伯嘉基金销售有限公司**

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：武汉市泛海国际 SOHO 城 7 栋 2301、2304

法定代表人：陶捷

公司网址：<http://www.buyfunds.cn>

客服热线：400-027-9899

**78) 北京晟视天下投资管理有限公司**

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21-28 层

公司网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

客服热线：400-818-8866

**79) 上海钜派钰茂基金销售有限公司**

注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室

法定代表人：胡天翔

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 10 楼

公司网址：[www.jpinvestment.cn](http://www.jpinvestment.cn)

客服热线：400-021-2428

**80) 北京蛋卷基金销售有限公司**

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

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

**81) 北京新浪仓石基金销售有限公司**

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

**82) 珠海盈米财富管理有限公司**

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

**83) 北京汇成基金管理有限公司**

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-90595

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

**84) 上海云湾投资管理有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

企业类型：有限责任公司

营业期限：持续经营

客服电话：400-820-1515

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

#### 85) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

注册资本：人民币 2000 万元

企业类型：有限责任公司

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

#### 86) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077-209

公司网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

#### （三）注册登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法人代表：弓劲梅

联系人：石楠

电话：010-66577769

传真：010-66577750

#### （四）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

#### (五) 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：赵柏基

经办注册会计师：单峰、庞伊君

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：庞伊君

## 六、基金份额的申购、赎回和基金间转换

### (一) 申购和赎回的场所

1、本基金的销售机构包括直销机构（包括本公司直销网点及网站）、基金管理人委托的代销机构，上述直销和代销机构的名称、住所等参见本招募说明书“五、相关服务机构”。

2、投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

3、基金管理人可以酌情增加或减少代销机构，并另行公告。

4、销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

### (二) 申购和赎回的办理时间

#### 1、开放日

基金开放日为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。基金开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。若出现新的证券交易市场或证券交易所交易时间更改或其他原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

## 2、申购的开始日及业务办理时间

本基金已于 2005 年 4 月 15 日起开始办理日常申购业务。

## 3、赎回的开始日及业务办理时间

本基金已于 2005 年 6 月 13 日起开始办理日常赎回业务。

## 4、申购和赎回的公告

在确定申购和赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开始日前两日内在至少一种中国证监会指定报刊和网站上公告。

### （三）申购、赎回和基金间转换的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回、基金间转换价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回、基金间份额转换”原则，即申购以金额申请，赎回、基金间转换以持有的基金份额申请。

3、当日的申购、赎回和基金间转换申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前两日内在至少一种中国证监会指定的报刊和网站上公告。

### （四）申购、赎回和基金间转换的程序

1、申请方式：书面申请或销售机构规定的其他方式。

2、投资者在提交申购基金的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回和基金间转换申请时，帐户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回和基金间转换的申请无效而不予确认。

3、申购、赎回和基金间转换的确认与通知：T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

4、申购、赎回款项和基金间转换份额的支付：基金申购采用全额缴款方式。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在 T+7 日内支付。基金份额持有人基金间转换申请注册登记机构于 T+1 日确认。发生延期支付的情形时，款项和份额的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

5、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

6、申购、赎回和基金份额转换的数额约定：

投资人按金额申购基金，首次申购基金最低金额 100 元，已有认购记录的投资者不受本限制；追加申购基金最低金额为 1 元。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时不受最低申购金额的限制。基金申购份额计量单位为份，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金财产。

投资人赎回和基金间转换时按份额赎回和基金份额转换基金，基金份额持有人可以申请将其持有的部分或全部基金份额赎回和基金间转换。基金单笔赎回最低份数为 100 份；赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金财产。

单笔基金转换最低份数为 1000 份；基金间转换份额计量单位为份，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金财产。当持有人持有基金份额低于 100 份时，基金管理人有权将该持有人持有的该基金份额全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，基金管理人最迟应于该调整实施前两日内在至少一种中国证监会指定的报刊和网站公告。

(五) 申购和赎回的费用

1、申购费率

本基金的申购费用由基金份额持有人承担，不列入基金财产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金的申购费用采用前端收费形式，申购费率具体如下表所示：

| 申购金额 (M)     | 申购费率    |
|--------------|---------|
| M<50万        | 1.5%    |
| 50万≤M<250万   | 1.2%    |
| 250万≤M<500万  | 0.75%   |
| 500万≤M<1000万 | 0.5%    |
| M≥1000万      | 每笔1000元 |

注：网上直销等特殊申购费率另见已发布的相关公告

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率。

2、赎回费率

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



费等，25%归基金财产。赎回费率随投资者持有本基金的时间的增加而递减，如下表所示：

| 连续持有期限（日历日）  | 赎回费率  |
|--------------|-------|
| 1天 ~ 365天    | 0.5%  |
| 366天（含）~730天 | 0.25% |
| 731天（含）以上    | 0     |

3. 自2013年6月14日起，基金管理人面向申购本基金的养老金客户实施特定申购费率，详情请参阅本基金管理人于2013年6月13日发布于中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金实施特定申购费率的公告》。

#### （六）申购份额和赎回金额的计算方式

##### 1、基金申购份额的计算

申购份额为申购金额除以以当日的基金份额净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，基金份额份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金财产。

$$\text{基金份额申购价格} = \text{基金份额净值} \times (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{基金份额申购价格}$$

例：某投资者投资5万元申购基金，对应费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{基金份额申购价格} = 1.016 \times (1 + 1.5\%) = 1.03124 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 50000 / 1.03124 = 48485.32 \text{ 份}$$

即：投资者投资5万元申购基金，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，则可得到48485.32份基金份额。

##### 2、基金赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格，赎回金额单位为元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属基金财产。

$$\text{赎回费} = \text{基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费}$$

例：某投资者赎回基金1万份基金份额，持有期小于1年，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费=1.0160×10000×0.5%=50.8 元

赎回金额= 1.0160×10000-50.8=10109.2 元

即：投资者赎回基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10109.2 元。

### 3、基金份额净值的计算

基金份额净值等于当日基金资产净值除以基金总份额。

#### (七) 申购、赎回和基金间转换的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者在 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金或基金间转换该基金份额。投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者扣除权益并办理注册登记手续。投资者进行基金转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者扣除基金转换前原持有基金的权益并办理转换后持有基金权益的注册登记手续。

#### (八) 拒绝或暂停申购、赎回和基金间转换的情形与处理

1、出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购和基金间转换申请：

(1) 不可抗力；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购和基金间转换可能对已有基金份额持有人利益产生损害；

(4) 基金管理人认为会严重损害已有基金份额持有人利益的其他申购和基金间转换；

(5) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

2、发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回和基金间转换申请：

(1) 不可抗力；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 连续两个开放日发生巨额赎回；

(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已确认的赎回和基金间转换申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回和基金间转换申请人，未支付部分可延期支付，在后续开放日予以支付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日。

暂停期间，每两周至少刊登一次提示性公告。暂停期间结束，基金重新开放赎回和基金间转换业务时，基金管理人应公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### （九）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理登记结算的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费。

本基金已于 2005 年 6 月 13 日起开放基金转换业务，具体实施办理详见相关公告。

#### （十）巨额赎回的情形及处理

##### 1、巨额赎回的认定

基金单个开放日，本基金赎回申请份额总数（包括基金间转换导致本基金减少的份额）扣除申购份额和其它基金转换为本基金份额后的总余额超过上一日本基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理

（1）全额赎回和基金间转换：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回和基金间转换时，按正常赎回和基金间转换程序执行。

（2）顺延赎回和基金间转换：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回和基金间转换比例不低于本基金总份额的 10%的前提下，可以对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回和基金间转换申请，应当按单个账户赎回和基金间转换申请量占赎回和基金间转换申请总量的比例，确定当日受理的赎回和基金间转换份额；赎回未受理部分可延迟至下一个开放日办理，基金间转换未受理部分不做延迟处理，但投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以下一个开放日的本基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。发生巨额赎回和基金间转换并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者基金合同、招募说明书规定的其他方式、在规定的时间内通知基金份额持有人，说明有关处理方法。同时在至少一种中国证监会指定的信息披露报刊和网站上公告，通知基金份额持有人，并说明有关处理方法；通知和公告的时间最长不得超过三个证券交易所交易日。

(3) 基金连续两个开放日以上发生巨额赎回和基金间转换，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回和基金间转换申请；已经确认的赎回和基金间转换申请可以延期支付赎回款项和基金间转换份额，但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(十一) 暂停申购、赎回或基金间转换的公告和重新开放申购、赎回或基金间转换的公告发生上述暂停申购、赎回或基金间转换情况的，基金管理人应在两日内向中国证监会及规定的派出机构备案并在指定媒体上刊登暂停公告。

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告并公布最近 1 个工作日的基金份额净值。

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、赎回或基金间转换时，基金管理人应提前两日内在至少一种中国证监会指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告，并在重新开放申购、赎回或基金间转换日公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，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，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束，基金重新开放申购、赎回或基金间转换时，基金管理人应提前两日内在至少一种中国证监会指定报刊和网站上连续刊登基金重新开放申购、赎回或基金间转换公告并在重新开放申购、赎回或基金间转换日公告最近一个工作日的基金份额净值。

## 七、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金通过风险预算的投资策略，力争获取超过业绩比较基准的长期稳定回报，分享市场向上带来的收益，控制市场向下的风险。

### (二) 业绩比较基准

一年期银行定期存款利率(税后)\*50%+富时中国 A200 指数\*20%+中证金融债指数\*15%+中证企业债指数\*10%+中证国债指数\*5%

本基金定位为中低风险的产品，无论市场向上还是向下，本基金将通过对投资组风险的控制，力争为投资者获取稳定的回报。

### （三）投资范围和投资对象

本基金的投资范围是国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

其中，股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股；债券投资范围包括一年以上的国债、金融债、企业债、可转债等；货币市场工具包括短期票据、回购、银行存款以及一年以内（含一年）的国债、金融债、企业债等。

本基金大类资产的投资比例范围是：股票 0—50%，债券 20%—70%，货币市场工具 5%—80%。

### （四）投资理念

通过对风险的事前控制获取稳定收益。

### （五）投资策略

#### 1、风险预算策略

本基金的投资管理将全面引进一种全新的投资策略——风险预算。这一技术是从荷兰银行的全球投资流程中移植过来的。风险预算技术是最近几年在欧洲和美国发展起来的，并很快得到了市场的认可，主要原因是它给投资流程带来的创新和附加值。

风险预算是指基金在投资组合构建和调整前基于对市场信心度的判断来分配风险，然后根据风险的分配限制来调整具体资产的投资策略，使未来的投资组合满足风险预算的要求，也就是说投资组合在构建和调整前其风险就已锁定。风险预算的策略将体现在投资的各个环节。大量应用数量化的事前和事后的风险控制手段是本基金的重要特色。投资组合资产配置比例的一个重要参考来自于数理化的风险预算。

本基金的风险预算范围：与业绩比较基准的年跟踪误差（事前）上限为 10%。

具体的操作流程是：

（1）投资决策委员会定期召开，形成对市场的看法，运用 MVPS 模型对市场进行综合评分得出对市场的信心度，信心度分为以下五类：非常有信心看空、有信心看空、中性、有信心看多、非常有信心看多。

（2）根据不同的信心度确定相应的投资组合风险预算范围，然后在风险预算范围内确定资产配置比例。

（3）基金经理根据资产配置比例确定下一阶段的投资操作策略，投资策略对组合的预期影响将通过专门的风险管理系统进行测试，看是否满足对风险预算的要求。

荷兰银行为了管理此类基金，专门开发了系统软件 LIBRA 进行事前风险预算和事后的风险控制。本基金将共享荷兰银行的这一系统，风险管理部定期将基金的投资策略、投资组合等数据传送至荷兰银行(伦敦)，通过 LIBRA 系统测算基金目标组合的风险程度，通过此项分析，风险管理部提出对现有组合的改进建议，作为基金资产配置的参考。

## 2、资产配置策略

研究部结合内外部研究成果，根据与荷兰银行投资管理公司共同开发的适用于国内市场的资产配置模型——MVPS 模型，提出资产配置方案。

MVPS 模型包括对以下四个方面的分析：

M：宏观经济环境（Macro Environment）

V：价值（Valuation）

P：国家对证券市场的政策（Policy）

S：市场气氛（Sentiment）。

### ①M—宏观经济环境（Macro Environment）

研究分析的主要指标包括

- ✓ 季度 GDP 的增长速度
- ✓ 每月 CPI 的数据
- ✓ 每月工业增加值的增长速度
- ✓ 货币供应量 M2 的增长

### ②V—价值（Valuation）

- ✓ P/B、P/E 运行模型

我们衡量市场整体价值的主要标准是 P/B 和 P/E，这两个指标有其自身的运行规律，都有价值回归的特征。当市场偏离真实价值太远时，都会有回归的趋势。现实中我们总是无法准确判断市场的真实价值是多少，而只能尝试用各种模型来描述其运行轨迹。通过实证分析，我们运用的 P/B、P/E 运行模型能基本显示市场的重要拐点。

- ✓ 公司治理结构

公司治理结构是影响证券市场发展的长期因素，这一因素虽然很难用具体指标来量化，但它的完善和优化，能促进企业的良性运作，最终在业绩和市场形象中得到体现。

### ③P—政策（Policy）

国家宏观经济政策和监管政策对证券市场下一阶段的发展具有重要影响作用。

#### ④S-气氛 (Sentiment)

市场气氛是证券市场政策发挥作用的土壤。在短期内，市场气氛是决定国家政策，甚至宏观政策变化在证券市场中能否得到体现的重要基础。市场气氛将主要考虑保证金、分析师指数、基金仓位、市场的特殊效应等方面。

投资决策委员会将每月召开例会，研究部将针对以上各层面提供分析报告，为投资决策会提供参考依据，会议将形成对 MVPS 的评分。

### 3、组合管理策略

在确定了基金下一阶段风险预算的范围和资产配置后，基金经理将在风险预算和资产配置范围的指导下，构建具体的投资组合。

#### (1) 债券组合管理

本基金将主要采用类属配置和个券选择的投资策略来运作债券组合。

债券的投资组合是自下而上和自上而下管理模式的结合。所谓自上而下，是指债券的投资策略是建立在对宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化等的分析基础之上的。通过对宏观面的分析，可以预测整个债券市场的下一步趋势，以及不同的债券类别包括国债、企业债、金融债和可转换债券未来的不同表现，同时可以确定在不同市场上交易的不同类型、不同到期年限债券的预期价值，据此可以发现市场的失衡情况，确定债券的投资策略。所谓自下而上，是指通过对比个券的久期、到期收益率、信用等级、税收因素等其他决定债券价值的因素，确定个券的投资价值。

类属配置指组合在银行间国债、交易所国债、金融债和企业债之间的配置比例。类属配置将基于对各类属的相对投资价值和走势预测，增持能给组合带来相对较高回报的类属，减持会给组合带来相对较低回报的类属。同时，风险管理部利用 LIBRA 系统，分析不同债券类属配置情况下的风险度，并同比较基准进行对比，提出对不同债券类别的配置比例的建议，作为基金经理进行债券组合的重要参考。

个券选择的标准包括：

- a. 符合总体投资理念的要求；
- b. 符合资产配置策略、调整策略和投资策略的要求，符合风险管理指标，包括流动性指标要求；
- c. 到期收益率相对类似信用质量和期限债券较好的债券；
- d. 风险水平合理、有较好下行保护的债券；

- e. 企业经营、财务状况及担保条件较好，信用质量较高的金融债或企业债券；
- f. 价值严重被低估的债券，包括可转换债券；

## （2）股票组合管理

选股方面，本基金力争在最好的行业中选择最好的公司，包括行业配置和个股选择两个层面。

泰达宏利的行业选择和选股将基于详细的行业文档。行业文档的研究方法是引进的荷兰银行的研究方法和平台，荷兰银行在运用行业文档、从行业视角来选择股票方面有很长时间的经验。

### 1) 行业配置

确定行业配置的主要依据为：根据行业文档进行分析，确定国内行业中具有竞争优势和比较竞争优势的行业。

行业文档的主要要素包括：

- a. 行业趋势不仅仅是从中国角度，还从全球视角来研究；
- b. 详细分析中国特定行业公司的独特运作；
- c. 主要业务的驱动因素和行业增长的驱动因素。

研究员对每个行业进行深入的分析，根据行业文档并结合对风险和收益的综合考虑，作出行业投资价值判断。

### 2) 利用市值指标作为流动性指标，对股票进行筛选，建立待投资股票库：

对股票市值大小进行排序，挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票，作为基础股票池；

以每月更新的个股未来每股收益预测值，对每股收益率影响较大的每股收益增长率、市盈率、市净率、每股现金流、流通市值等基本因素和技术因素为指标建立数据库。

3) 对重点公司进行深入研究，包括商业评估、公司评估、价值评估和盈利预测，从而在基础股票库中寻找价格合理、基本面良好的上市公司。

## （六）风险管理

“中低风险”和“风险预算”是本基金的两大特点，这对本基金管理人的风险管理提出了更高的要求。本基金管理人充分吸收了外方股东荷兰银行在风险管理上的技术，并结合在中国资本市场中风险管理的经验，构建了多层次、全方位的内部控制机制和完善的内部控制制度体系，涵盖前台、中台、后台各个方面的工作、各项工作环节和流程。



在此基础上，针对本产品的特点，本基金将共享荷兰银行的风险管理软件“LIBRA”。它的最大特点是能够把多种不同类别的资产整合在一起进行风险管理。本基金为混合基金，投资的资产类别包括股票、债券和货币市场工具。“LIBRA”能够进行风险分解，把整个组合的风险分为资产配置的风险、资产类别的风险，分析组合风险的来源，分析不同的投资策略对组合风险的影响，从而在构建投资组合前，使投资组合、投资策略的风险与预期收益相匹配。

本基金将使用风险预算技术，根据对市场的信心度控制组合的跟踪误差，动态调整组合的资产配置、行业、债券类属配置和个股、个券选择，风险管理部根据风险管理指标监控组合的风险水平，定期出具风险分析报告，对组合的业绩和风险进行归因分析，找到基金管理人的优势所在，为风险分配提供依据，力争战胜业绩比较基准，在不增加额外风险的基础上通过积极的投资管理获取超额收益。

#### （七）风险收益特征

基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于风险中低的证券投资基金。

#### （八）投资限制

本基金的投资限制：

- 1、本基金投资于一家上市公司股票，其市值不超过该基金资产净值的10%；
- 2、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、本基金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的股票发售总量；
- 4、不违反基金合同中对投资比例、投资策略等的约定；
- 5、中国证监会规定的其他比例限制。

本基金于基金合同生效之日起六个月内，在正常情况下应达到上述比例限制。

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比例规定的，基金管理人可以在十个交易日内进行调整，以使基金投资符合上述规定。有关法律、法规、规章或中国证监会对上述比例另有规定时，从其规定。

#### （九）建仓期

本基金的建仓期为基金合同生效之日起六个月以内。

#### （十）禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

- (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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (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者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者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。

(十一) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司或发债公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

(十二) 基金投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、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止 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

**1、报告期末基金资产组合**

| 序号 | 项目     | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 61,579,085.72  | 27.31        |
|    | 其中：股票  | 61,579,085.72  | 27.31        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 110,246,891.50 | 48.89        |
|    | 其中：债券  | 108,361,891.50 | 48.05        |
|    | 资产支持证券 | 1,885,000.00   | 0.84         |
| 4  | 贵金属投资  | -              | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | 46,080,189.12  | 20.43  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 5,807,236.85   | 2.58   |
| 8 | 其他资产              | 1,791,008.46   | 0.79   |
| 9 | 合计                | 225,504,411.65 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,358,940.00  | 1.52         |
| B  | 采矿业              | 2,283,003.00  | 1.03         |
| C  | 制造业              | 37,800,604.26 | 17.08        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,356,185.80  | 1.52         |
| E  | 建筑业              | 2,235,955.36  | 1.01         |
| F  | 批发和零售业           | 4,484,680.80  | 2.03         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 204,846.41    | 0.09         |
| J  | 金融业              | 1,145,170.49  | 0.52         |
| K  | 房地产业             | 5,607,784.60  | 2.53         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,101,915.00  | 0.50         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 61,579,085.72 | 27.83        |

## 3、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 4、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 600393 | 粤泰股份 | 99,600 | 1,202,172.00 | 0.54         |
| 2  | 002493 | 荣盛石化 | 84,392 | 1,164,609.60 | 0.53         |
| 3  | 300121 | 阳谷华泰 | 65,100 | 1,162,686.00 | 0.53         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 000890 | 法尔胜  | 97,900  | 1,161,094.00 | 0.52 |
| 5  | 002545 | 东方铁塔 | 114,700 | 1,156,176.00 | 0.52 |
| 6  | 002016 | 世荣兆业 | 119,300 | 1,154,824.00 | 0.52 |
| 7  | 000735 | 罗牛山  | 174,800 | 1,150,184.00 | 0.52 |
| 8  | 002010 | 传化股份 | 58,600  | 1,148,560.00 | 0.52 |
| 9  | 002311 | 海大集团 | 69,300  | 1,148,301.00 | 0.52 |
| 10 | 002123 | 梦网荣信 | 66,600  | 1,148,184.00 | 0.52 |

### 5、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 18,757,200.00  | 8.48         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,051,000.00  | 13.58        |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,051,000.00  | 13.58        |
| 4  | 企业债券      | 29,193,691.50  | 13.19        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 30,360,000.00  | 13.72        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 108,361,891.50 | 48.97        |

### 6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称             | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 160414    | 16农发14           | 300,000 | 30,051,000.00 | 13.58        |
| 2  | 112252    | 15鄂能01           | 200,000 | 20,832,000.00 | 9.41         |
| 3  | 101669021 | 16中材集<br>MTN002  | 200,000 | 20,254,000.00 | 9.15         |
| 4  | 010303    | 03国债(3)          | 150,000 | 15,745,500.00 | 7.12         |
| 5  | 101664036 | 16同盛投<br>资MTN001 | 100,000 | 10,106,000.00 | 4.57         |

### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码    | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|---------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 1689104 | 16金诚1A1 | 100,000 | 1,885,000.00 | 0.85         |

### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资于股指期货,该策略符合基金合同的规定。

## 11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货,该策略符合基金合同的规定。

### 11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 12、报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产(单位:元)

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 377,283.30   |
| 2  | 应收证券清算款 | 62,114.63    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,337,550.48 |
| 5  | 应收申购款   | 14,060.05    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,791,008.46 |

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

八、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。

本基金合同生效日为 2005 年 4 月 5 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

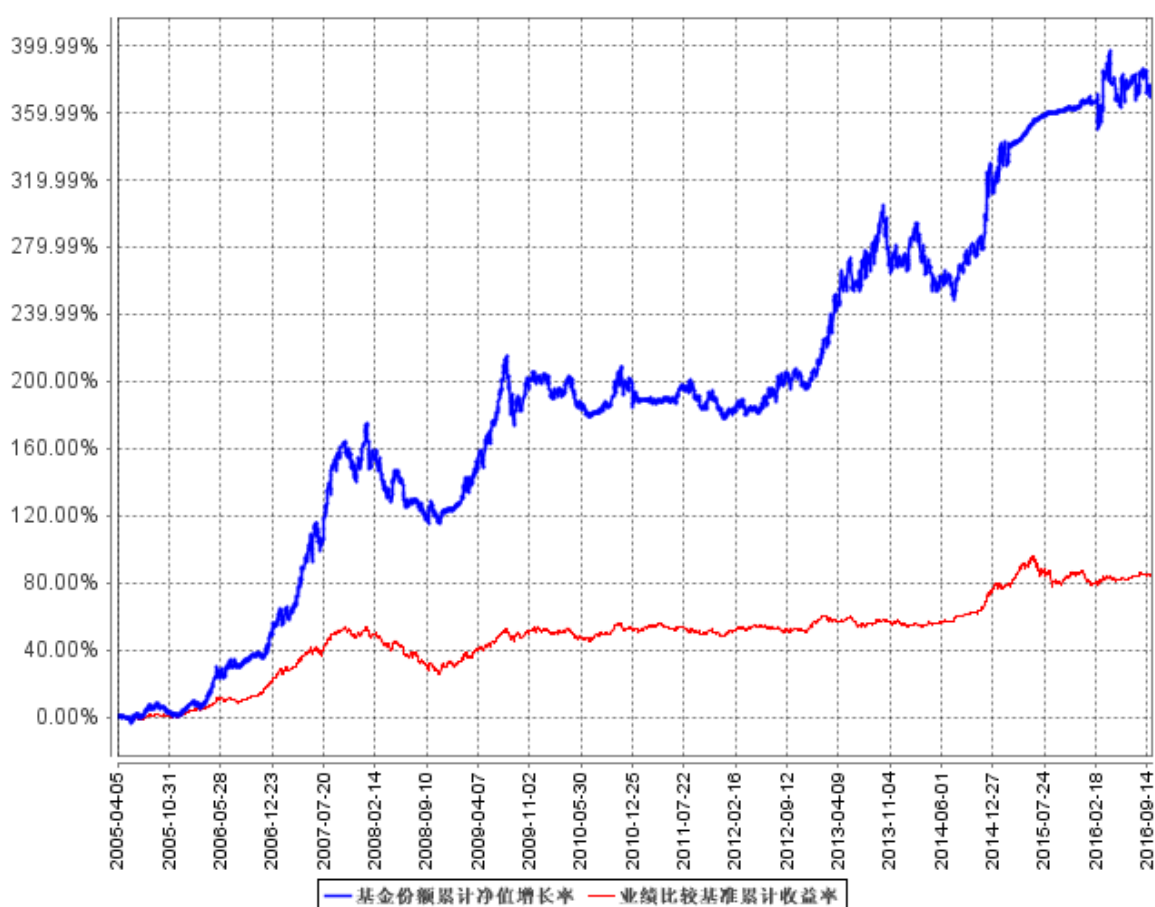
(一) 截止 2016 年 9 月 30 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

| 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 | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------|---------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
|                         | ①       | ②        | ③         | ④            |        |       |
| 2005.4.5~<br>2005.12.31 | 4.00%   | 0.47%    | 1.65%     | 0.25%        | 2.35%  | 0.22% |
| 2006.1.1~<br>2006.12.31 | 49.40%  | 0.71%    | 20.93%    | 0.32%        | 28.47% | 0.39% |
| 2007.1.1~<br>2007.12.31 | 68.81%  | 1.15%    | 23.02%    | 0.50%        | 45.79% | 0.65% |
| 2008.1.1~<br>2008.12.31 | -14.74% | 0.87%    | -14.01%   | 0.57%        | -0.73% | 0.30% |
| 2009.1.1~200<br>9.12.31 | 36.27%  | 0.87%    | 17.40%    | 0.42%        | 18.87% | 0.45% |
| 2010.1.1~201<br>0.12.31 | -4.73%  | 0.63%    | -0.18%    | 0.31%        | -4.55% | 0.32% |
| 2011.1.1~201<br>1.12.31 | -3.47%  | 0.35%    | -2.40%    | 0.25%        | -1.07% | 0.10% |
| 2012.1.1~201<br>2.12.31 | 9.74%   | 0.53%    | 5.20%     | 0.25%        | 4.54%  | 0.28% |
| 2013.1.1~201<br>3.12.31 | 21.40%  | 0.92%    | -0.42%    | 0.28%        | 21.82% | 0.64% |
| 2014.1.1~201            | 11.70%  | 0.78%    | 14.30%    | 0.26%        | -2.60% | 0.52% |

|                         |          |        |         |        |          |         |
|-------------------------|----------|--------|---------|--------|----------|---------|
| 4. 12. 31               |          |        |         |        |          |         |
| 2015. 1. 1~2015. 12. 31 | 12. 10%  | 0. 40% | 4. 75%  | 0. 48% | 7. 35%   | -0. 08% |
| 2016. 1. 1~2016. 9. 30  | 0. 81%   | 0. 72% | -0. 92% | 0. 29% | 1. 73%   | 0. 43%  |
| 基金合同生效以来至2016. 9. 30    | 371. 21% | 0. 75% | 84. 88% | 0. 37% | 286. 33% | 0. 38%  |

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动比较图

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## 九、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指运用基金募集资金购买的各类有价证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资形成的价值总和。

## （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值，包括有价证券、银行存款本息、应收款项以及待摊费用等。

## （三）基金财产的帐户

基金托管人代表本基金，以托管人和本基金联名的方式开立证券帐户，以本基金名义在托管银行开立银行存款帐户并报中国证监会备案。基金托管人以自身名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。本基金帐户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构自有资产帐户以及其他基金财产帐户相独立。

## （四）基金财产的保管与处分

1、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、基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

5、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

6、除依据法律法规、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。



## 十、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通股票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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，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）—

（2）小项规定的方法对基金资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。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

(1) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

(4) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

(6) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(8) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（7）小项规定的方法对基金资产进行估值，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）—

（7）小项规定的方法对基金资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。

(9) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日

在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，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)项规定的方法对基金资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。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额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规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (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) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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投资人的利益，已决定延迟估值；

(4) 如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资产的；

(5) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (七) 基金份额净值的计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日基金资产净值 /  $T$  日基金总份额余额

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

（1）当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）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。当估值或基金份额净值计价出现错误实际发生时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

#### （2）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、注册登记人、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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投资人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。

#### （3）差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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有差错责任方和未更正方依法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) 如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，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、行政法规、本基金合同或其他规定，基金管理人或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，则基金管理人或基金托管人有权向出现差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) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### (4) 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人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

(1) 基金管理人按本条第(四)项“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”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,基金管理人和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,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但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。

## 十一、基金的收益和分配

### (一) 基金收益的构成

- 1、本基金投资所得红利、股息、债券利息;
- 2、本基金买卖证券价差;
- 3、本基金银行存款利息;
- 4、已实现的其他合法收入;
- 5、运用本基金财产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

### (二) 基金净收益

本基金净收益为本基金收益扣除按照国家有关规定可以在本基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三) 基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等的分红收益权;
- 2、根据自身情况,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,每年分配次数最多不超过四次,合同生效不满3个月,收益可不分配;年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成;
- 3、本基金收益分配采用现金方式,持有人可以选择现金分红方式或者将现金红利按红利发放日前一基金份额净值自动转为基金份额进行红利再投资方式,以基金份额持有人在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准,基金份额持有人选择分红的默认方式为现金分红方式;
- 4、本基金当年收益弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;
- 5、本基金投资当期出现净亏损,则基金不进行收益分配;
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下,基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的

50%；

7、本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在分配方案实施前两日内由基金管理人公告，并报中国证监会及其派出机构备案。

#### （五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将基金份额持有人的现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值转为相应基金份额。具体业务规则以公告的收益分配方案为准。

## 十二、基金的费用与税收

### （一）基金运作费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金的证券交易费用；

4、基金合同生效后的本基金信息披露费用；

5、基金合同生效后与本基金相关的会计师费和律师费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

### （二）基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理费按基金前一日的资产净值的 0.70% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理人于 2015 年 11 月 5 日发布《关于降低泰达宏利风险预算混合型证券投资基金管

理费并修改基金合同和托管协议的公告》，决定自 2015 年 11 月 5 日起，将本基金的基金管理费率由 0.90%/年降为 0.70%/年。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照基金管理人划款指令于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

基金的基金托管费按基金前一日的资产净值的 0.25%的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金托管费；

E：为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、上述（一）3 至 7 项费用由基金托管人根据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，由基金托管人按照基金管理人的划款指令复核后从本基金资产中支付。基金合同生效前的验资费（会计师费）、律师费、信息披露费用从基金认购费用中列支。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

## （三）申购、赎回的费用和基金间转换的费用

### 1、申购费

申购费率如下：

| 申购金额（M）          | 费率      |
|------------------|---------|
| M < 50万          | 1.50%   |
| 50万 ≤ M < 250万   | 1.20%   |
| 250万 ≤ M < 500万  | 0.75%   |
| 500万 ≤ M < 1000万 | 0.50%   |
| M ≥ 1000万        | 每笔1000元 |

注：网上直销等特殊申购费率另见已发布的相关公告

### 2、赎回费



赎回费率如下：

| 连续持有期限（日历日）    | 适用的赎回费率 |
|----------------|---------|
| 1 天—365 天      | 0.5%    |
| 366 天（含）—730 天 | 0.25%   |
| 731 天（含）以上     | 0       |

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本基金连续持有期限超过 365 天，赎回费率为 0.25%；连续持有期限超过 730 天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的 25%划归基金资产。

### 3、基金间转换费

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理登记结算的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本基金财产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依据国家有关法律、法规的规定履行纳税义务。

## 十三、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，记帐单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、各基金独立建帐、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计帐目、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；

7、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、本基金管理人聘请与基金管理人和基金托管人相独立并具有相关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。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须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（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，在2日内编制完成更换会计师事务所的临时报告，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和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。

## 十四、基金的信息披露

### （一）基金信息披露的原则

本基金的信息披露应符合《基金法》、《信息披露办法》、本基金合同及其他有关规定。基金信息披露义务人应当在中国证监会规定的时间内，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和基金管理人、基金托管人和互联网网站等媒介披露，并保证投资人能够按照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。

### （二）基金募集信息披露

1、基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将招募说明书、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。

2、基金管理人应当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、基金管理人应当在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。

4、基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，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。基金管理人应当在公告的

十五日前向中国证监会报送更新招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

### （三）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定编制，由基金托管人复核。基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 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。

2、基金半年度报告：基金管理人应当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。

3、基金季度报告：基金管理人应当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。

### （四）基金资产净值及基金份额净值公告

1、基金合同生效后，在开始办理基金份额申购和赎回前，每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2、每开放日的次日披露该开放日基金份额净值和基金份额累计净值；

3、在半年度和年度最后一个市场交易日的次日公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。

### （五）临时报告与公告

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，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和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）提前终止基金合同；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）基金管理人或基金托管人变更；
- （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 50%；

(10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员一年内变更达 30%以上；

(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 0.5%；

(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) 开始办理申购、赎回和基金间转换业务；

(22) 基金申购、赎回、基金间转换费率及其收费方式发生变更；

(23) 基金发生巨额赎回并顺延支付；

(24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回和基金间转换申请；

(25) 其它暂停基金申购、赎回和基金间转换的情形；

(26) 暂停后重新接受基金申购、赎回和基金间转换的情形；

(27) 证监会规定的其他重大事项。

#### (六) 澄清公告与说明

在基金合同期限内，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份额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。

#### (七) 信息披露事务管理

1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息披露事务。

2、基金托管人须对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关信息进行复核、审查，并就此向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

3、本基金的基金合同、招募说明书、更新招募说明书等公告文本在编制完成后，应存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

## 十五、风险揭示

本基金存在的主要风险有：

### （一）市场风险

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而产生风险，主要包括：

1、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，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，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，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。

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导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、行业选择风险：本基金强调以行业为导向进行个股投资，如果出现行业背景发生较大变化与行业趋势变化预测产生较大差异，可能会影响本基金的投资收益而产生风险。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

### （三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，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。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （四）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

### （五）基金间转换所产生的风险

在基金间转换时，可能使相关的基金的规模发生较大改变，从而对转出和转入基金的原持有人利益产生影响。

### （六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 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；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、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；
- 7、其他意外导致的风险。

## 十六、基金合同的终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金合同期限届满而未延期的；
- 2、基金份额持有人大会决定终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 4、基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。自基金合同终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，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。

清算小组作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。

清算后的剩余基金财产，应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

#### （二）基金财产清算小组

1、基金合同终止之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对终止后的基金进行基金清算。

2、基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在基金合同终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金财产清算小组可以聘请必要的工作人员。

3、基金财产清算小组接管基金财产后，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）基金财产清算小组的职责

- 1、基金合同终止后，发布基金清算公告；
- 2、基金财产清算小组统一接管终止后的基金财产；
- 3、对终止后的基金财产进行清理和确认；
- 4、对终止后的基金财产进行估价；
- 5、对基金财产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；

- 8、公布终止后的基金清算结果公告；
- 9、进行终止后的基金剩余资产的分配。

(四) 清算程序

- 1、基金财产的接管
- 2、基金财产的清理
- 3、基金财产的确认
- 4、基金财产的评估
- 5、基金财产的分配

(五) 清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从终止的基金财产中支付。

(六) 基金财产按下列顺序清偿

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

基金财产未按前款 1 至 3 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(七) 基金财产清算的公告

基金财产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，报中国证监会备案后，按照有关规定予以公告。

(八) 清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十七、基金合同内容摘要

(一) 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) 按照规定要求召开或召集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，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律、法规、规章规定的和基金合同约定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及按照规定支付相应费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法利益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 法律、法规、规章和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利和义务

### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法申请并募集基金，自基金合同生效之日起，依照法律及基金合同的规定运用并管理基金财产；
- (2) 依照基金合同收取基金管理费及其他约定和法定的费用；
- (3) 依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同或国家有关法律规定，致使基金财产或基金份额持有人利益产生重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；
- (4) 在符合有关法律法规的前提下，决定基金的相关费率结构和收费方式，但本基金合同规定应由基金份额持有人大会批准的，从其规定；
- (5) 发售基金份额，收取认购、申购和基金间转换费用；
- (6) 召集基金份额持有人大会；

(7) 代表本基金对其所投资的企业依法行使股东权利；

(8) 行使因投资于其它证券所产生的权利；

(9) 担任注册登记机构或委托其他合法机构担任注册登记机构；

(10) 委托合法的销售代理机构，并对其销售服务代理行为进行监督；根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(11) 在基金合同规定的情形出现时，决定暂停受理基金份额的申购、赎回和基金间转换；

(12) 决定基金收益的分配方案；

(13) 根据基金合同的规定提名新基金托管人；

(14) 于基金终止时，组建或参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(15) 有关法律、法规、规章和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(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并运用基金财产；

(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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和基金间转换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进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务；

(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；

(7) 确保所管理的基金财产和基金管理人的自有资产相互独立，确保所管理的每只基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(8) 除法律、法规、规章和基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人运作基金财产；

- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 按规定计算并公告基金份额的认购、申购、赎回和基金间转换价格的方法；
- (11) 按照法律法规、基金合同及其他有关规定，履行信息披露和报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露或为了基金审计的目的而做出的披露不应视为基金管理人违反基金合同规定的保密义务；
- (13) 按约定向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按约定受理申购、赎回和基金间转换申请，及时、足额支付赎回款项和转换后的基金份额；
- (15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (16) 依照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；
- (17) 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 15 年以上；
- (18) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；并且保证投资人能够按照招募说明书规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- (19) 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；
- (20) 当面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其财产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (21) 基金管理人因违反本基金合同规定处分基金财产，或者因违背本基金合同规定的管理职责、处理基金事务不当而致使基金财产受到损失的，应采取适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿，其违约责任不因其退任而免除；
- (22) 基金托管人因违约造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；
- (23) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- (24) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (25) 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者实施其他法律行

为；

- (26) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (27) 有关法律、法规、规章和基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利和义务

#### 1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的规定，取得基金托管费；
- (3) 依法监督基金的投资运作；
- (4) 根据基金合同的规定提名新基金管理人；
- (5) 提议召开基金份额持有人大会；
- (6) 法律、法规、规章和基金合同规定的其他权利。

#### 2. 基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同，依法持有基金财产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金的全部资产；
- (3) 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、合格的熟悉基金托管业务专职人员从事基金财产托管事宜；
- (4) 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自有资产相互独立；对其托管不同基金分别设置帐户，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；
- (5) 除法律、法规、规章及基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人托管基金财产；
- (6) 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；
- (7) 以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户；以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开立一个或多个证券账户；以托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户；以基金的名义在中央国债登

记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。严格执行基金管理人的投资指令，认真办理基金投资于证券的清算交割及基金名下的资金往来；

(8) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及本基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值或基金份额净值；

(10) 采取适当、合理的措施使开放式基金份额的认购、申购、赎回和基金间转换等事项符合基金合同等有关法律文件规定；

(11) 采取适当、合理的措施使基金管理人用以计算开放式基金份额的认购、申购、赎回、基金间转换的方法符合基金合同等有关法律文件规定；

(12) 采取适当、合理的措施使基金投资和融资的条件符合基金合同等有关法律文件规定；

(13) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国银监会和中国证监会；

(14) 按照法律法规和基金合同的约定监督基金管理人的投资运作，在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行，如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(15) 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

(16) 按照有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

(17) 按规定制作相关账册并与基金管理人及时核对；

(18) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金收益和赎回款项支付到专用账户；

(19) 参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 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银监会，并通知基金管理人；

(21) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(22) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其违约责任不因其退任

而免除；

(23) 监督基金管理人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金管理人违约造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 有关法律、法规、规章和基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法授权的代表共同组成。

##### 2、召开事由

(1) 有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；

2) 提前终止基金合同；

3) 变更基金类别；

4) 变更基金投资目标、范围或策略；

5) 变更基金份额持有人大会程序；

6) 更换基金管理人；

7) 更换基金托管人；

8) 本基金与其它基金合并；

9) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

10) 单独或合计持有本基金 10%以上基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就涉及本基金同一事项以书面方式提议召开基金份额持有人大会；

11) 基金管理人或基金托管人就涉及本基金的事项提议召开基金份额持有人大会；

12) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 以下情况不需召开基金份额持有人大会，由基金管理人和基金托管人协商后进行修改：

1) 调低基金管理费、基金托管费，其他应由基金承担的费用；

2) 在基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率、基金间转换费率或收费方式;

3) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改;

4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;

5) 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) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1)除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集,开会的时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人确定;

(2)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,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3)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。

(4)代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。

(5)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、召开基金份额持有人大会的通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 天在中国证监会指定的至少一种报刊和网站上公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序；
- (3) 出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 如采用通讯表决方式，则载明投票表决的截止日以及表决票的送达地址；

(7) 采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

#### 5、召开方式

##### (1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- 3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- 4) 会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人更换的事项必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

- 1) 现场开会必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：
  - ①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额不少于代表权益登记日基金总份额的50%；
  - ②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律、法规和规章、基金合同及会议通知的规定。

##### 2) 通讯方式开会必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- ①本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金



份额不少于代表权益登记日基金总份额的50%。

②直接出具书面意见的基金份额持有人和受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明及授权委托书手续完备，出具的相关文件符合有关法律、法规和规章、基金合同及会议通知的规定。

对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律、法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。代理人在通讯方式开会中进行表决时，应向召集人同时提交有关基金份额持有人出具的有效授权委托书；

③基金份额持有人大会召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

④会议通知公布前报中国证监会备案。

## 6、审议事项与程序

### (1) 议事内容及提案权

基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有基金份额10%以上基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案最迟应当在大会召开日前10日提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有审议事项的修改及增加临时提案应当在基金份额持有人大会召开日5日前公告。

对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与本基金有直接关系，并且不超出法律、法规和本基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以

就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，需由单独或合并持有权利登记日基金总份额 20% 以上的基金份额持有人提交；基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在开会通知中公告审议事项、具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式等。在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 7、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议。

### 1) 一般决议

对一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% 以上都通过方为有效；除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

## 2) 特别决议

转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同为特别决议事项，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。

(4) 采取通讯开会方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中选举两名代表与大会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，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和代理人中选举三名代表担任监票人；

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) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者代理人对大会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要求进行重新清点，监票人应当立即重新清点，重新清点仅限一次。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

计票过程由公证机关予以公证。

### (2) 通讯开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，并在公告基金份额持有人大会决议时公告公证书全文、公证机关及公证员姓名。

## 9、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决议自经中国证监会核准或者备案之日起生效，法律法规及中国证监会另有规定的除外。基金管理人在基金份额持有人大会决议生效之日起两日内在至少一种指定

报刊和网站公告。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人及基金托管人均有法律约束力。

(五) 基金合同变更和终止的事由及程序

1、变更基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；

(2) 提前终止基金合同；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、范围或策略；

(5) 变更基金份额持有人大会程序；

(6) 更换基金管理人；

(7) 更换基金托管人；

(8) 本基金与其它基金合并；

(9) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(10) 单独或合计持有本基金 10%以上基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就涉及本基金的同一事项以书面方式提议召开基金份额持有人大会；

(11) 基金管理人或基金托管人就涉及本基金的事项提议召开基金份额持有人大会；

(12) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人就变更内容协商一致后公布，并报中国证监会备案：

(1) 因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

(2) 基金合同的变更并不导致基金合同当事人权利义务发生变化的；

(3) 因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合

同内容必须作出相应变动的。

2、基金合同变更后应报中国证监会及其派出机构核准或备案，并在变更后两日内公告。

### 3、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

(1) 基金合同期限届满而未延期的；

(2) 基金份额持有人大会决定终止的；

(3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

(4) 基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。自基金合同终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，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。

清算小组作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。

清算后的剩余基金财产，应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

### (六) 争议的解决

基金合同各方当事人因《基金合同》而产生的一切争议，如经协商或调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点在北京，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

### (七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得基金合同的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

## 十八、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：泰达宏利基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：弓劲梅

注册资本：1.8亿元人民币

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

法定名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

企业类型：股份有限公司

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元人民币

（二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规规定和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是

否及时执行基金管理人的指令、是否将基金资产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项,对基金托管人进行监督和核查。

(1) 基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的,基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定,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及时核对并以书面形式对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。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。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议,基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金资产的安全和基金投资者的利益,包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金资产的损失向基金托管人索赔。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本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) 基金资产的保管

#### 1、基金资产保管的原则

(1) 基金资产的保管责任,由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《信托法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定,为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,谨慎、有效的持有并保管基金资产。

(2) 基金托管人应当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，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据《基金法》、《信托法》、《运作办法》、本《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于该基金资产；基金托管人不得将基金资产转为其固有财产，不得将固有资产与基金资产进行交易，或将不同基金资产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金资产的原状、承担赔偿责任。

(5) 基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，将基金资产与其托管的其他基金资产严格分开；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的账簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

(6) 除依据《基金法》、《信托法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## 2、基金合同生效时募集资金的验证和入账

(1) 基金设立募集期满或基金宣布停止募集时，由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并分别出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金资产的全部资金划入基金托管人基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。



(3) 本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其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

#### 4、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本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和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金、结算互保基金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理，而限于上述关于账户开设、使用的规定。

(5) 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、国债托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向银行监管部门进行报备。

#### 6、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 7、与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件由基金托管人保管。

#### (四) 基金资产净值计算与会计复核

##### 1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的该基金份额资产净值，并在盖章后以加密传真方式发送给相应的基金托管人。该基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人；如果基金托管人的复核结果与相应的基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布，相应的基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

##### 2、基金账册的建账和对账

(1) 基金管理人和基金托管人在本基金《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

(2) 双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

##### 3、基金财务报表与报告的编制和复核

(1) 基金财务报表由相应的基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，

应于每月终了后 5 日内完成；季度报告在本基金《基金合同》生效后每季度公告一次，在每季终了后 10 个工作日内编制完毕，并于每季终了后 15 个工作日内予以公告；招募说明书在本基金《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，20 日内编制完毕，于该等期间届满后 45 日内公告。半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

(2) 基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给相应的基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在招募说明书更新完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 20 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

(3) 基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，该基金的基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以该基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

#### (五) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，应当根据有关法律法规的规定妥善保管之。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的，基金管理人（注册登记机构）应当提供任何必要的协助。

#### (六) 适用法律与争议解决

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金/基金管理人、基金/基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守基金/基金管理人和基金/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，维护各基金份额持有人的合法权益。

#### （七）托管协议的修改和终止

1、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，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或《基金合同》终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 十九、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、基金投资人交易资料的对账服务

- （1）基金份额持有人可登陆本公司网站（<http://www.mfcteda.com>）查阅对账单。
- （2）基金份额持有人也可向本公司定制纸质、电子或短信形式的定期或不定期对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线 400-698-8888 咨询。

#### 2、其它相关的信息资料

### （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，注册登记机构将其所获红利按红利发放日前一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）基金间转换

指本基金存续期间，基金管理人接受本基金份额持有人的申请，将其持有的基金份额转换为本基金管理人管理的另一基金的基金份额的行为。

### （四）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以定时定额申购基金份额。

本基金已于 2006 年 8 月 1 日开通定期定额投资业务，具体要求请见相关公告。

根据 2015 年 4 月 18 日基金管理人发布《泰达宏利基金管理有限公司关于网上直销平台调整旗下开放式基金申购金额下限的公告》，本公司自 2015 年 4 月 20 日起，投资者通过本公司官方网上直销、微信公众平台（微信号：mfcteda\_BJ）定期定额申购单笔最低金额为 10 元。

### （五）在线服务

基金管理人利用自己的网站 <http://www.mfcteda.com> 定期或不定期为基金投资者提供投资策略分析报告、基金月度报告以及与基金经理（或投资顾问）的定期在线交流的服务。

### （六）网上开户与交易服务

支持基金管理人旗下网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、中国银行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、广发银行卡和汇付天下“天天盈”、支付宝账户。

泰达宏利微信公众账号：mfcteda\_BJ, 支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下“天天盈”账户和快钱支付账户。

基金管理人决定对通过本公司网上基金直销交易系统申购本公司旗下基金的客户实行优惠申购费率。

上述具体详情请查看公司网站或相关公告。

### （七）资讯服务

泰达宏利基金管理有限公司客服中心为投资者提供 7\*24 小时的电话语音服务，投资者可通过客服电话 400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 的语音系统或登录公司网站 <http://www.mfcteda.com>，查询基金净值、基金帐户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在

工作时间还将为您提供周到的人工答疑服务。

#### （八）投诉受理

投资人可以拨打泰达宏利基金管理有限公司客户服务中心电话 400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

## 二十、其他应披露事项

1. 本基金管理人已于 2016 年 4 月 6 日及 4 月 7 日分别发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

2. 本基金管理人已于 2016 年 4 月 16 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告》。

3. 本基金管理人已于 2016 年 4 月 20 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

4. 本基金管理人已于 2016 年 4 月 21 日发布《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》。

5. 本基金管理人已于 2016 年 4 月 25 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利风险预算混合型证券投资基金分红的公告》。

6. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 5 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告》。

7. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 7 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

8. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 7 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

9. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 7 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

10. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 10 日、5 月 11 日、5 月 12 日及 5 月 13 日分别发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

11. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 14 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

12. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 17 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告》。

13. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 19 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

14. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 19 日发布《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金更新招募说明书正文及摘要》。

15. 本基金管理人已于 2016 年 5 月 25 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

16. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 1 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

17. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 1 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

18. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 1 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

19. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 4 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在部分销售机构申购金额下限的公告》。

20. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 14 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

21. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 17 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告》。

22. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》。

23. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

24. 本基金管理人已于 2016 年 6 月 29 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告》。

25. 本基金管理人已于 2016 年 7 月 5 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

26. 本基金管理人已于 2016 年 7 月 9 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告》。

27. 本基金管理人已于 2016 年 7 月 9 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资、转换业务并参加其费率优惠活动的公告》。

28. 本基金管理人已于 2016 年 7 月 19 日发布《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》。

29. 本基金管理人已于 2016 年 8 月 16 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

30. 本基金管理人已于 2016 年 8 月 18 日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加中信证券、中信山东、中信期货费率优惠活动的公告》。

31. 本基金管理人已于 2016 年 8 月 20 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参与浙江同花顺基金销售有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告》。

32. 本基金管理人已于 2016 年 8 月 29 日发布《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金 2016 年半年度报告正文及摘要》。

33. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 6 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》。

34. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 6 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告》。

35. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 6 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》。

36. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 6 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》。

37. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 19 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司费率优惠活动的公告》。

38. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 20 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海云湾投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

39. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 20 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告》。

40. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 27 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。

41. 本基金管理人已于 2016 年 9 月 27 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。



## 二十一、招募说明书存放及查阅方式

存放地点：本基金招募说明书存放于基金管理人、基金托管人、基金销售服务机构住所。

查阅方式：投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

## 二十二、备查文件

（一）本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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他文件。

（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式

- 1、存放地点：基金管理人和基金托管人的住所
- 2、查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资人也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司

2016年11月18日