

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书（更新）

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日期：二〇一六年十二月

重要提示

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由原天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）（以下简称“深证成指基金”）转型而成。依据 2015 年 4 月 22 日天弘深证成分指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议通过，并经证券基金机构监管部部函【2014】1249 号文变更注册，深证成指基金由指数型 LOF 基金转为灵活配置混合型基金、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金”。自 2015 年 5 月 7 日起，由《天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》修订而成的《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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变更注册，但中国证监会接受本基金转型的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金并非保本基金，基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金

代销业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金招募说明书自基金合同生效之日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

目 录

一、绪言	4
二、释义	5
三、基金管理人	9
四、基金托管人	19
五、相关服务机构	25
六、基金的历史沿革	56
七、基金的存续	57
八、基金份额的申购与赎回	58
九、基金的投资	68
十、基金的融资融券	76
十一、基金投资组合报告	77
十二、基金的业绩	81
十三、基金的财产	82
十四、基金资产的估值	83
十五、基金的收益与分配	88
十六、基金费用与税收	90
十七、基金的会计与审计	92
十八、基金的信息披露	93
十九、风险揭示	99
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	102
二十一、基金合同的内容摘要	104
二十二、基金托管协议的内容摘要	126
二十三、对基金份额持有人的服务	140
二十四、其他应披露事项	142
二十五、招募说明书存放及查阅方式	145
二十六、备查文件	146

一、绪言

《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《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》”)以及《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“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,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
- 2、深证成指基金：指天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）
- 3、基金管理人：指天弘基金管理有限公司
- 4、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 5、基金合同或本基金合同：指《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书：指《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义

务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

22、销售机构：指天弘基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

23、登记业务：指基金登记、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、基金份额登记、基金销售业务的确认、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和办理非交易过户等

24、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为天弘基金管理有限公司或接受天弘基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。本基金的基金登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

25、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

26、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

27、基金转型：指对包括深证成指基金转为灵活配置混合型基金，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订《天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基

金合同》，并更名为“天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金”等一系列事项的统称

28、基金合同生效日：指《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金》生效之日即深证成指基金终止上市之日，原《天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、存续期：指《天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起至《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

33、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

35、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

36、《业务规则》：指基金管理人及登记机构有关开放式证券投资基金登记方面的相关业务规则

37、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

38、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

39、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

40、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

41、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账

户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

42、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

43、元：指人民币元

44、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

45、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

46、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

47、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

48、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

49、指定媒介：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介

50、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

成立日期：2004 年 11 月 8 日

法定代表人：井贤栋

联系电话：(022) 83310208

组织形式：有限责任公司

注册资本及股权结构

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164号），于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元，股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员基本情况

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴(中国)信息技术有限公司财务副总裁、

支付宝(中国)网络技术有限公司首席财务官,浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司首席运营官,现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司 CEO。

卢信群先生,副董事长,硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书,北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司董事长、总经理,君正国际投资(北京)有限公司董事,河北大安制药有限公司董事。

黄浩先生,董事,大学本科。历任中国建设银行总行计财部副处长,处长,部门副总经理、中德住房储蓄银行行长、中国建设银行总行网络金融部总经理。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司副总裁。

屠剑威先生,董事,硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行(中国)有限公司合规部助理总裁、永亨银行(中国)有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司法务及合规部高级研究员。

付岩先生,董事,大学本科。历任北洋(天津)物产集团有限公司期货部交易员,中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员,顺驰(中国)地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部总经理。

郭树强先生,董事,总经理,硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理,天弘创新资产管理有限公司董事长、总经理。

魏新顺先生,独立董事,大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长,天津市政府法制办经济法规处处长,天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。

张军先生,独立董事,博士。现任复旦大学经济学院院长,中国经济研究中心主任。

贺强先生,独立董事,本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生,监事会主席,硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记,

天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。

张杰先生，监事，注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，内蒙古中鑫能源有限公司董事，内蒙古坤德物流股份有限公司监事。

方隽先生，监事，硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经理、福建立信闽都会计师事务所副主任会计师、立信会计师事务所厦门分所副主任会计师。现任芜湖高新投资有限公司总经理。

韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。

张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、天弘基金市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理，现任本公司互联网金融业务部副总经理。

付颖女士，监事，硕士研究生。历任天弘基金监察稽核部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司监察稽核部副总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生，副总经理，硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监兼固定收益部总经理，分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市

场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司电子商务业务。

童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管，本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

姜晓丽女士，经济学硕士，7年证券从业经验。历任本公司债券研究员兼债券交易员，光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员，本公司固定收益研究员，天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理。现任天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘通利混合型证券投资基金基金经理、天弘瑞利分级债券型证券投资基金基金经理、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

钱文成先生，理学硕士，10年证券从业经验。自2007年5月加盟本公司，历任本公司行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理、天弘周期策略混合型证券投资基金基金经理（2013年5月至2016年2月期间）。现任天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘通利混合型证券投资基金基金经理、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金经理、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘新价值灵活配置混合型证券投资

资基金基金经理、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金经理、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘乐享保本混合型证券投资基金基金经理、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王林先生，工商管理硕士，15年证券从业经验。历任长城证券有限责任公司分析师、嘉实基金管理有限公司研究员、中国人寿资产管理公司投资经理、建信基金管理有限公司投资经理。2014年11月加盟本公司，历任本公司机构投资部副总经理，现任天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、固定收益总监兼固定收益部总经理，基金经理。

陈勤先生，本公司总经理助理，投资决策委员会联席主席、股票投资总监兼机构投资总监。

钱文成先生，基金经理。

刘冬先生，基金经理。

肖志刚先生，基金经理。

陈国光先生，基金经理。

王登峰先生，基金经理。

姜晓丽女士，基金经理。

王林先生，基金经理。

黄颖女士，研究总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人的职责

- 1、依法办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金注册或备案手续；
- 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、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 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、按照规定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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人遵守法律的承诺

本基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

基金管理人禁止性行为的承诺。

本基金管理人依法禁止从事以下行为：

- （1）将其自有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止

的其他行为。

2、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着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、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏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) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、风险管理的原则

(1) 全面性原则：公司风险管理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：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核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：公司及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；

(5) 重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，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：

(1) 董事会：负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险；

(2) 督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向审计与风险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；

(3) 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；

(4) 风险管理委员会：根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生

的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告；

(5) 监察稽核部：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提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

(6) 风险管理部：通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制；

(7) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的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、内部控制制度综述

(1) 风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

(2) 监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设督察长和监察稽核部。督察长全面负责公司的监察稽核工作，可在授权范围内列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核，出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会。如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。

监察稽核部具体执行监察稽核工作，并协助督察长工作。监察稽核部具有独

立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见，并提交风险管理委员会；检查公司各部门执行内部管理制度的情况；监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性；监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部的违规事件；协助监管机关调查处理相关事项；负责员工的离任审计；协调外部审计事宜等。

(3) 内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程，确保会计业务有章可循；按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制；为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度；为了确保基金资产的安全，公司严格规范基金清算交割工作，并在授权范围内，及时准确地完成基金清算；强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度；为了防止会计数据的毁损、散失和泄密，制定了完善的档案保管和财务交接制度。

4、风险管理和内部风险控制的措施

(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。公司建立、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。公司建立、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。公司建立了风险管理委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；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，从而以最快速度做出决策；

(5) 建立内部监控系统。公司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，用以提示市场趋势、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。公司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。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

2、主要人员情况

截至 2015 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2015 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 496 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上

海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

4、基金托管人的职责

基金托管人应当履行下列职责：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (5) 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；
- (6) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (7) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (9) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (10) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (11) 法律法规和基金合同规定的其它职责。

(二) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年中国工商银行资产托管部第九次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服

务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当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）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管

人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管

理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

(一) 基金销售机构

1、直销机构:

(1) 天弘基金管理有限公司直销中心

住所: 天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

办公地址: 天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人: 井贤栋

电话: (022) 83865560

传真: (022) 83865563

联系人: 司媛

客服电话: 400-710-9999 (免长途话费)

(2) 天弘基金管理有限公司网上直销平台

办公地址: 北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层

电话: (010) 83571739

传真: (010) 83571840

联系人: 许丛立

网址: www.thfund.com.cn

(3) 天弘基金管理有限公司北京分公司

办公地址: 北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层

电话: (010) 83571789

传真: (010) 83571900

联系人: 申向阳

(4) 天弘基金管理有限公司上海分公司

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号 30 层 E-F 单元

电话: (021) 50128808

传真: (021) 50128801

联系人：涂远宏

(5) 天弘基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区华夏路 26 号 12 楼 V16 房

电话：(020) 38927920

传真：(020) 38927985

联系人：袁宇鹏

2、其他销售机构：

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66105799

传真：010-66107914

联系人：李鸿岩

客服电话：95588

网站：www.icbc.com.cn

(2) 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

电话：010-68858095

传真：010-68858117

联系人：文彦娜

客服电话：95580

网站：www.psbc.com

(3) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门内大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

电话：010-65557046

传真：010-65550827

联系人：迟卓

客服电话：95558

网站：bank.ecitic.com

(4) 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 号华夏银行大厦

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：吴建

电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：刘军祥

客服电话：95577

网站：www.hxb.com.cn

(5) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

办公地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

法定代表人：何沛良

电话：0769-961122

传真：0769-22320896

联系人：杨亢

客服电话：0769-961122

网站：www.drcbank.com

(6) 厦门银行股份有限公司

注册地址：厦门市湖滨北路 101 号商业银行大厦

办公地址：厦门市湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

电话：0592-2275261

传真：0592-5061952

联系人：刘冬阳

客服电话：400-858-8888

网站：www.xmbankonline.com

(7) 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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 9 楼

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客服电话：95511-3

网站：bank.pingan.com

(8) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 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：于波涛

客服电话：96528、962528

网站：www.nbcb.com.cn

(9) 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甲 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223587

传真：010-66225309

联系人：刘章

客服电话：95526

网站: www.bankofbeijing.com.cn

(10) 南京银行股份有限公司

注册地址: 南京市中山路 288 号

办公地址: 南京市中山路 288 号

法定代表人: 林复

电话: 025-86775335

联系人: 张小光

客服电话: 40088-96400

网站: www.njcb.com.cn/

(11) 浙商银行股份有限公司

注册地址: 浙江杭州庆春路 288 号

办公地址: 浙江杭州庆春路 288 号

法定代表人: 张达洋

电话: 0571-87659546

联系人: 唐燕

客服电话: 95527

网站: www.czbank.com

(12) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 山东省济南市经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号 23 层

法定代表人: 李玮

电话: 021-20315255

传真: 021-20315137

联系人: 许曼华

客服电话: 95538

网站: www.qlzq.com.cn

(13) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市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 (奥体中心北侧)

法定代表人：杜庆平

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：胡天彤

客服电话：400-6515-988

网站：www.bhzq.com.cn

(14) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

网站：www.htsec.com

(15) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场 8 层

办公地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场 8 层

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

联系人：周一涵

客服电话：400-881-6168

网站：www.pingan.com

(16) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：400-888-8788、10108998

网站：www.ebscn.com

（17）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座
41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A
座

法定代表人：杜航

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客服电话：400-886-6567

网站：www.avicsec.com

（18）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

网站：www.cscoc.com.cn

（19）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：邓颜

电话：010-66568888

传真：010--66568536

联系人：田薇

客服电话：400-8888-888

网站：www.chinastock.com.cn

（20）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A座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄婵君

客服电话：400-8888-111、95565

网站：www.newone.com.cn

（21）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 39 层

法定代表人：许刚

电话：021-20328704

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

客服电话：400-620-8888

网站：www.bocichina.com.cn

（22）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁衷民

电话：021-53519888

传真：021-53519888

联系人：许曼华

客服电话：400-891-8918、021-962518

网站：www.shzq.com

(23) 新时代证券有限责任公司

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

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：田芳芳

客服电话：400-698-9898

网站：www.xsdzq.cn

(24) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-65183880

传真：010-65182261

联系人：张颢

客服电话：400-8888-108

网站：www.csc108.com

(25) 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

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：付研

客服电话：400-888-8999

网站：www.95579.com

(26) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市长乐路 989 号 40F

法定代表人：储晓明

电话：021-54041654

传真：021-33388217

联系人：王叔胤

客服电话：95523、400-889-5523

网站：www.sywg.com.cn

(27) 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

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：郑向溢

客服电话：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

(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

办公地址：北京市西城区大平桥大街 19 号

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客服电话：400-800-0562

网站：www.hysec.com

(29) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290537

传真：025-51863323

联系人：庞晓芸

客服电话：400-8888-168、95597

网站：www.htsc.com.cn

(30) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 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：万建华

电话：18801962504

传真：021-38670666

联系人：朱雅崑

客服电话：400-8888-666

网站：www.gtja.com

(31) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 5 楼

法定代表人：吴志明

电话：(8620)88836999-5408

传真：(8620)88836920

联系人：梁微

客服电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

(32) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

电话：010 63081493

联系人：尹旭航

客服电话：400-800-8899

网站：www.cindasc.com

(33) 英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦 30、31 层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦 30、31 层

法定代表人：赵文安

电话：0755-83007069

传真：0755-83007167

联系人：赵楠

客服电话：0755-26982993

网站：www.ydsc.com.cn

(34) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层

法定代表人：李工

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

联系人：汪燕

客服电话：96518、400-809-6518

网站：www.hazq.com

(35) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：赵彩玲

客服电话：010-66045678

网站：www.txsec.com

（36）国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客服电话：95570

网站：www.glsc.com.cn

（37）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690126

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪

客服电话：400-660-0109

网站：www.gjq.com.cn

（38）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、19 号楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：王一彦

客服电话：400-888-8588、95531

网站: www.longone.com.cn

(39) 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

法定代表人: 余维佳

电话: 023-63786141

传真: 023-63786212

联系人: 张煜

客服电话: 400-809-6096

网站: www.swsc.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

办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人: 黄金琳

电话: 0591-87383623

传真: 0591-87383610

联系人: 张腾

客服电话: 0591-96326

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 16-26 层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人: 何如

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133952

联系人: 李颖

客服电话: 95536

网站: www.guosen.com.cn

(42) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

电话：021-68777222

传真：021-68777723

联系人：刘闻川

客服电话：400-820-9898

网站：www.cnhbstock.com

(43) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2246273

传真：0551-2272100

联系人：李蔡

客服电话：95578

网站：www.gyzq.com.cn

(44) 西藏东方财富股份有限公司

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：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：周艳琼

客服电话：400-881-1177

网站：www.xzsec.com

(45) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：王薇

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：袁峻

客服电话：021-63340678

网站：www.ajzq.com

(46) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 11 层

法定代表人：雷杰

电话：010-57398063

传真：010-57398058

联系人：刘丹

客服电话：95571

网站：www.foundersc.com

(47) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：侯艳红

客服电话：95558

网站：www.cs.ecitic.com

(48) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

电话：0769-22116557

传真：0769-22119423

联系人：柯天池

客服电话：0769-961130

网站：www.dgzq.com.cn

（49）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

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 16-20 层

法定代表人：余政

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：王东

客服电话：400-619-8888

网站：www.msyzq.com

（50）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

（266061）

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：孙秋月

客服电话：0532-95548

网站：www.zxwt.com.cn

（51）中邮证券有限责任公司

注册地址：西安市碑林区太白北路 320 号

办公地址：西安市高新区唐延路 5 号陕西邮政大厦 9-11 层

法定代表人：李春太

电话：029-88602147

传真：029-88602138

联系人：吉亚利

客服电话：4008-888-005

网站：www.cnpsec.com.cn

(52) 湘财证券有限责任公司

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 楼

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 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：李欣

客服电话：400-888-1551

网站：www.xcsc.com

(53) 华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656

传真：0931-4890118

联系人：邓鹏怡

客服电话：400-689-8888

网站：www.hlzqgs.com

(54) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：宋德清

电话：010-58568235

传真：010-58568062

联系人：李慧灵

客服电话：010-58568118

网站：www.hrsec.com.cn

(55) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 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

电话：020-87555888-8333

传真：020-87555305

联系人：黄岚

客服电话：95575

网站：www.gf.com.cn

(56) 浙商证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6-7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6-7 楼

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901912

传真：0571-87902092

联系人：毛亚莉

客服电话：0571-967777

网站：www.stocke.com.cn

(57) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83709350

传真：0755-83700205

联系人：牛孟宇

客服电话：95563

网站：www.ghzq.com.cn

(58) 联讯证券有限责任公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四
楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四
楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119397

传真：0752-2119396

联系人：郭晴

客服电话：400-8888-929

网站：www.lxzq.com.cn

(59) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

客服电话：400-600-0686

网站：www.nesc.cn

(60) 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：福州市湖东路 268 号证券大厦 16F

法定代表人：兰荣

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

联系人：夏中苏

客服电话：95562

网站：www.xyzq.com.cn

(61) 大同证券经纪有限责任公司

注册地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

法定代表人：董祥

电话：0351-7219303

联系人：张冠

客服电话：4007121212

网站：www.dtsbc.com.cn

(62) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

联系人：杨涵宇

客服电话：400-910-1166

网站：www.rtfund.com

(63) 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：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人：姚文平

联系人：刘熠

客服电话：95353

网站：www.tebon.com.cn

(64) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：0512-62938521

联系人：陆晓

客服电话：400-860-1555

网站： www.dwjq.com.cn

（65）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 号中信证券大厦 14 层

法定代表人：张皓

电话：0755 -23953913

联系人：洪诚

客服电话：400-9908-826

网站： www.citicsf.com

（66）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融大厦 38 层

法定代表人：张冠宇

电话：13121820670

传真：010-59200800

联系人：刘美薇

客服电话：400-819-9868

网站： www.tdyhfund.com

（67）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层
4609-10 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

电话：13810692890

联系人：贾一夫

客服电话：400-021-8850

网站：<http://www.harvestwm.cn/>

(68)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：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法人代表：陈柏青

电话：0571-26888888

联系人：韩爱彬

客户服务热线：400-0766-123

网站：www.fund123.cn

(69)上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法人代表：其实

电话：186-1193-5050

联系人：沈硕

客户服务热线：400-181-8188

网站：www.1234567.com.cn

(70)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（200120）

法定代表人：杨文斌

电话：13916988520

联系人：陆敏

客户服务热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(71)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼

法人代表：凌顺平

电话：13116765372

联系人：刘晓倩

客服：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(72)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

电话：13911828608

联系人：刘洋

客服电话：400-920-0022

网址：www.licaike.com

(73)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号37244

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法人代表：汪静波

电话：021-38509680

联系人：张裕

客户服务热线：400-821-5399

网站：www.noah-fund.com

(74)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

联系人：童彩平

客户服务热线：400-6788-887

网址: www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(75)北京展恒基金销售有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人: 闰振杰

联系人: 张云

电话: 010-59601366-7024

客服: 400-818-8000

网址: www.myfund.com

(76)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层

法人代表: 彭运年

电话: 010-59336519

联系人: 孙雯

客户服务热线: 010-59336512

网址: www.jnlc.com

(77)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

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法人代表: 肖雯

电话: 18500050725

联系人: 李孟军

客户服务热线: 020-89629066

网站: www.yingmi.cn

(78)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

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法人代表：郭坚

电话：15921301165

联系人：程晨客户服务热线：4008-6666-18

网址：www.lu.com

(79) 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

法人代表：张跃伟

电话：021-20691923

联系人：苗明客户服务热线：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(80) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室

法人代表：齐小贺

电话：0755-83999907-806

联系人：黄晶龙

客户服务热线：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

(81) 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

办公地址：上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法人代表：冯修敏

电话：156-0185-8632

联系人：秦琼

客户服务热线：400-821-3999

网址：www.chinapnr.com

(82) 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#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法人代表：杨懿

电话：18502354557 联系人：文雯

客户服务热线：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

(83) 浙江金观诚财富管理有限公司

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

办公地址：浙江省杭州市登云路 43 号金诚集团 10 楼

法人代表：徐黎云

电话：0571-88337717

联系人：孙成岩

客户服务热线：400-068-0058

网址：www.jincheng-fund.com

(84) 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 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：南京市建邺区江东中路 222 号奥体中心文体创业园

法人代表：袁顾明

电话：15921264785

联系人：朱海涛

客户服务热线：400-928-2266

网址：www.dtfortune.com

(85) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法人代表：沈继伟

电话：18601735759

联系人：徐鹏

客户服务热线：400-067-6266

网址：www.leadbank.com.cn

(86) 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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法人代表：燕斌

电话：021-52822063

联系人：陈东

客户服务热线：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

(87) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 soho1008-1012

法人代表：赵荣春

电话：18501250851

联系人：陈剑炜

客户服务热线：400-893-6885

网站：www.dyxtw.com

(88) 众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：13611256407

客服：400-059-8888

网址：www.wy-fund.com

(89) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：13424264100

客服：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(90) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：中国北京西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人：梁蓉

联系人：李婷婷

电话：18600948425

客服：400-6262-818

网址：<http://www.5irich.com/>

(91) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：张得仙

电话：13520443582

客服：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

(92) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：18001102931

客服：400-068-1176

网址：www.fundzone.cn

(93) 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

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：陈幸欣

电话：18310599275

客服：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

(94) 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

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 27 号嘉铭中心 B 座 10 层

法定代表人：梁越

联系人：祖杰

电话：13754547656

客服：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构新增为本基金的销售机构，并及时公告。

(二) 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938854

传真：010-50938991

联系人：徐盖

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号楼时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号楼时代金融中心 19 楼

法定代表人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：薛竞、周祎

联系人：周祎

六、基金的历史沿革

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金由天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）转型而成。

天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）于2010年5月20日经中国证监会证监许可[2010]666号文核准募集，基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）自2010年7月8日起至2010年8月6日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》于2010年8月12日生效，并于2010年9月17日起在深圳证券交易所上市交易。

2015年4月22日天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，基金份额持有人大会审议了《关于天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》，经基金份额持有人大会表决通过，上述决议决议生效。根据基金份额持有人大会决议，天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）将自深证成指基金终止上市之日转型为天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金。

七、基金的存续

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金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份额的申购与赎回。

(二) 申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2015 年 5 月 25 日开放日常申购、赎回、定期定额投资申购业务；具体办理流程见基金管理人于 2015 年 5 月 22 日在指定媒介发布的相关公告。

(三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(四) 申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上提前公告。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往投资人银行账户。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

(五) 申购和赎回的数量限制

1、本基金在代销机构及本公司网上交易系统的首次单笔最低申购金额为人民币 1 元(含申购费、下同)，追加申购的单笔最低申购金额为人民币 1 元；本公司直销网点(不含网上交易系统)的首次单笔最低申购金额为人民币 10,000 元，追加申购的单笔最低申购金额为人民币 1,000 元。各销售机构对最低申购限

额及级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔赎回不得少于1份。某笔赎回导致基金份额持有人在某一销售机构全部交易账户的份额余额少于1份的，基金管理人有权强制该基金份额持有人全部赎回其在该销售机构全部交易账户持有的基金份额。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于1份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。各销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理赎回业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(六) 申购和赎回的费用

1、申购费用

本基金的申购费率如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.00%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费用

本基金的赎回费率如下表所示：

持有时间 (T)	赎回费率
----------	------

T<7 天	1.50%
7 天≤T<30 天	0.75%
30 天≤T<1 年	0.50%
1 年≤T<2 年	0.25%
T≥2 年	0

注：一年指 365 天，两年为 730 天。

深证成指基金份额持有人持有的原登记在证券登记结算系统的份额，持有期限自重新确认与登记之日起计算；基金份额持有人原登记在注册登记系统的份额，持有期限自其认购/申购深证成指基金份额确认之日起计算。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人，其赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日少于 90 日的投资人，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 90 日但少于 180 日的投资人，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 180 日的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

3、基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在《招募说明书（更新）》中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式开始实施前 2 个工作日在指定媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，申购份额的计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

(注：对于 500 万（含）以上的适用绝对费用数额的申购，净申购金额=申购金额-申购费用)

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

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

基金份额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 1：假定 T 日的基金份额净值为 1.450 元，四笔申购金额分别为 1000 元、100 万、300 万元和 1000 万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下表：

	申购 1	申购 2	申购 3	申购 4
申购金额（元，a）	1,000.00	1,000,000.00	3,000,000.00	10,000,000.00
适用申购费率（b）	1.50%	1.00%	0.80%	每笔 1000 元
净申购金额（c=a/(1+b)）	985.22	990099.01	2976190.48	9,999,000.00
申购费（d=a-c）	14.78	9900.99	23809.52	1,000.00
基金份额净值（e）	1.450	1.450	1.450	1.450
申购份额（=c/e）	679.46	682826.90	2052545.16	6,895,862.07

2、赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，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并扣除相应的费用，赎回金额的计算公式如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

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

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

赎回金额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 2：假定某投资者在 T 日赎回四笔 1,000.00 份基金份额，持有期限分别为 6 天、28 天、90 天、370 天和 730 天，该日基金份额净值为 1.150 元，则各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下表：

	赎回 1	赎回 2	赎回 3	赎回 4	赎回 5
--	------	------	------	------	------

赎回份额 (份, a)	1,000.00	1,000.00	1,000.00	1,000.00	1,000.00
基金份额净值 (b)	1.150	1.150	1.150	1.150	1.150
赎回总金额 (c=a×b)	1,150.00	1,150.00	1,150.00	1,150.00	1,150.00
持有期限	6 天	28 天	90 天	370 天	730 天
适用赎回费率 (d)	1.50%	0.75%	0.50%	0.25%	0.00%
赎回费用 (e=c×d)	17.25	8.63	5.75	2.875	0
净赎回金额 (元, f=c-e)	1,132.75	1,141.38	1,144.25	1147.13	1,150.00

3、本基金基金份额净值的计算

T 日基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值/T 日基金份额的余额数量

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

(八) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人

的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将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申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

(十) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公布最近一个开放日的基金份额净值。

(十二) 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。

(十三) 基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

(十四) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户,或者按照相关法律法规或国家有权机构要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人,或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的处理方式。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

(十五) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

(十六) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十七) 基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

九、基金的投资

(一) 投资目标

本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

(二) 投资范围

本基金的投资对象是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)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、股指期货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的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

本基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

(三) 业绩比较基准

本基金投资业绩的比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%,即中国人民银行公布并执行的三年期金融机构人民币存款基准利率(税后)+0.75%。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人和基金托管人协商一致,并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

(四) 风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

（五）投资策略

本基金采取灵活资产配置，主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过深入的基本面研究分析，精选具有良好投资价值的投资品种，构建投资组合。

1、资产配置策略

本基金通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场研判进行前瞻性的资产配置决策。在大类资产配置上，本基金将通过对各种宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、货币供应增长率、市场利率水平等）的分析和预测，研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势，同时，积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化，分析其对不同类别资产的市场影响方向与程度，通过考察证券市场的资金供求变化以及股票市场、债券市场等的估值水平，并从投资者交易行为、企业盈利预期变化与市场交易特征等多个方面研判证券市场波动趋势，进而综合比较各类资产的风险与相对收益优势，结合不同市场环境下各类资产之间的相关性分析结果，对各类资产进行动态优化配置，以规避或分散市场风险，提高并稳定基金的收益水平。

2、债券等固定收益类资产的投资策略

本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据不同债券类金融工具的到期收益率、流动性和市场规模等情况，并结合各债券品种之间的信用利差水平变化特征、宏观经济变化以及税收因素等的预测分析，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，对各类债券金融工具进行优化配置，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。

（1）久期选择

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

（2）收益率曲线分析

本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期，并适时调整基金的债券投资组合。

(3) 债券类属选择

本基金根据对金融债、企业债（公司债）、可转债等债券品种与同期限国债之间利差（可转债为期权调整利差（OAS））变化分析与预测，确定不同类属债券的投资比例及其调整策略。

(4) 个债选择

本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。对于含权类债券品种，如可转债等，本基金还将结合公司基本面分析，综合运用衍生工具定价模型分析债券的内在价值。

(5) 信用风险分析

本基金通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

(6) 中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。本基金将采用谨慎投资策略进行中小企业私募债券的投资，在重点分析和跟踪发债主体的信用基本面基础上，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定具体个券的投资策略。

3、股票投资策略

本基金通过自下而上的公司基本面全面分析，并以前瞻性的投资视角，精选优质价值型股票进行重点投资。

(1) 价值型股票初选

本基金基于宏观经济、行业趋势、公司经营以及证券市场运行的深入研究，选取市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市价现金流比（P/CF）、市价股息比（P/D）等指标，通过对上市公司各定量指标的纵向分析与横向比较，选择具有综合比较优势、价值被相对低估的上市公司股票构成价值型股票投资初选对象。

(2) 公司价值动态增长分析

公司经营受到内部、外部多重因素的影响，任何因素的变化都会引起公司价值的变动，因此，科学、客观地把握公司价值的动态增长是分析并判断股票投资价值的核心。

公司价值增长以建立在核心业务基础之上的企业增长为基础，背后的驱动因

素则包括商业模式、品牌和营销、市场规模与技术创新、产业政策、经营团队和管理水平等，并最终体现为销售收入、利润和投资资本报酬率等各类绩效指标的增长。具备核心业务基础的公司需要具有四个方面的特征，即市场份额领先、盈利能力较强、具有较强的抗竞争能力和稳固的财务基础。

本基金将从运用定性与定量相结合的分析方法，考察上市公司核心业务的增长及其经营绩效，并通过对驱动公司价值增长各因素的分析与评判，考察公司价值增长的持续性。具体来说，具有以下综合优势的优质上市公司将构成本基金的重点投资对象：

- 1) 主营业务突出，公司的业务与经营符合国家产业政策或产业升级方向；
- 2) 产品或服务具有足够的市场容量与规模，良好的市场品牌形象，市场份额领先；
- 3) 优秀的管理团队，清晰的公司发展战略，勇于进行管理创新，具有良好的资源获取和资源整合能力；
- 4) 建立在核心业务基础上的技术创新、产品或服务创新、市场创新；
- 5) 良好的盈利增长能力，财务稳健。

(3) 公司基本面分析

在对上市公司进行相对价值比较和公司价值增长趋势分析的过程中，全面的公司基本面分析将贯穿其中。

公司基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。基本面分析的目的是从定性和定量两个方面考量行业竞争趋势、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素，业务发展的关键点等，进而做出明确的公司评价和投资建议。

(4) 权证投资策略

本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析，以有利于资产增值为原则，加强风险控制，谨慎参与投资。

5、股指期货投资策略

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。

1) 避险保值

利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

2) 有效管理

利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

（六）投资决策流程

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

（2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；

（3）国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

（1）备选库的形成与维护

对于债券投资，分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差（OAS）对普通债券和含权债券进行分析，在此基础上形成基金债券投资的信用债备选库。

对于股票投资，分析师根据各个行业及个股的投资评级，确定股票初选库，在此基础上，通过对上市公司基本面的全面考察，筛选出优质上市公司股票，并经投研会议审议批准后，进入股票投资备选库，分析师将对备选库的股票进行跟踪分析，并及时提出调整建议。

（2）资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议。

（3）构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，审议并确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投研会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

（4）交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(5) 投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况，风险管理部与监察稽核部对基金投资进行日常监督，风险管理分析师负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估，对基金投资组合不断进行调整和优化。

(七) 投资组合限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票投资比例范围为基金资产的 0%-95%；
- (2) 本基金每个交易日日终在扣除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；
- (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全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (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) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 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 20%；
- (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合计规模的 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) 基金财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) 本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：

1) 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的 10%，持有的卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的 20%；

2) 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；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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（不含到日期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；

4) 本基金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%；

(17) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(18) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需要经过基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(八) 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十、基金的融资融券

待基金参与融资融券业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年12月5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至2016年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

以下内容摘自本基金2016年度3季度报告：

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,758,719.12	54.25
	其中：股票	29,758,719.12	54.25
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	18.23
	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	14,962,403.16	27.27
8	其他资产	136,477.89	0.25
9	合计	54,857,600.17	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	3,415,480.04	6.76
B	采矿业	—	—
C	制造业	17,819,292.53	35.25
D	电力、热力、燃气及水生产和	—	—
E	建筑业	1,026,216.08	2.03
F	批发和零售业	2,992,669.75	5.92
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	—	—
J	金融业	3,734,729.72	7.39
K	房地产业	496,359.00	0.98
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	273,972.00	0.54
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	29,758,719.12	58.86

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明 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	002458	益生股份	61,174	2,555,849.72	5.06
2	000028	国药一致	24,867	1,784,207.25	3.53
3	002475	立讯精密	87,800	1,775,316.00	3.51
4	002583	海能达	130,869	1,608,380.01	3.18
5	600867	通化东宝	68,855	1,564,385.60	3.09
6	601311	骆驼股份	84,700	1,499,190.00	2.97
7	601009	南京银行	122,800	1,259,928.00	2.49
8	601607	上海医药	61,250	1,208,462.50	2.39
9	002480	新筑股份	87,500	1,135,750.00	2.25
10	002160	常铝股份	100,048	1,033,495.84	2.04

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 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债券投资明 细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证 券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 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。

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权证投资明 细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	108,494.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,556.96
5	应收申购款	3,728.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	21,698.00
8	其他	—
9	合计	136,477.89

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002160	常铝股份	1,033,495.84	2.04	披露重大事项

11.6 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。

十二、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 2015 年 5 月 7 日，基金业绩数据截至 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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015/5/7- 2015/12/31	17.03%	0.53%	2.56%	0.01%	14.47%	0.52%
2016/1/1- 2016/9/30	1.46%	0.32%	2.60%	0.01%	-1.14%	0.31%
自基金合同 生效日 (2015/5/7) -2016/9/30	18.74%	0.44%	5.22%	0.01%	13.52%	0.43%

注：本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+0.75%，即中国人民银行公布并执行的三年期金融机构人民币存款基准利率（税后）+0.75%。

十三、基金的财产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十四、基金资产的估值

(一) 估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

(二) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

(三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(四) 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，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；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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:

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,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,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,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的情况下,按成本估值。

(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,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、因持有股票而享有的配股权,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,按成本估值。

5、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。

6、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

7、中小企业私募债券,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,按成本估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知

对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（六）估值错误的处理

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资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；

由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误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,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

(2)估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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(“受损方”),则估值错误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估值错误责任方。

(4)估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1)查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4)根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托

管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 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，决定延迟估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(九) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十五、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权，今后若增加、减少或调整基金份额类别，则同类别内每一份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

十六、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券、期货账户开户费用和银行账户维护费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、基金的会计与审计

(一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、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) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

十八、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时,本基金从其最新规定。

(二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露,并保证基金投资者能够按照《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。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2、对证券投资业绩进行预测;
- 3、违规承诺收益或者承担损失;
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。

如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

(五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

(1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确

基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在其网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上;基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金转型事宜的基金份额持有人大会决议表决通过后,基金管理人应当将经中国证监会注册的基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;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各自网站上。

2、基金资产净值、基金份额净值

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

3、基金份额申购、赎回价格

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

4、基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人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媒介上。基金年度报告

的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人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媒介上。

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媒介上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

5、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的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) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (8) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (9) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (10) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (11) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(12) 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；

(13) 重大关联交易事项；

(14) 基金收益分配事项；

(15) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

(17) 基金改聘会计师事务所；

(18) 变更基金销售机构；

(19) 更换基金登记机构；

(20) 本基金开始办理申购、赎回；

(21) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(22) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(23) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

(24) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

(25) 中国证监会规定的其他事项。

6、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共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者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

7、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

8、投资股指期货相关公告

在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

9、基金投资中小企业私募债券的信息

(1) 基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等

信息；

(2) 基金管理人应当在基金季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

10、中国证监会规定的其他信息。

(六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,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基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

(七) 暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:

1、不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值;

4、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

(八) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。

十九、风险揭示

(一) 市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响,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。随着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。基金投资于债券,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。利率直接影响着债券的价格和收益率,影响着企业的融资成本和利润,并通过对股票市场走势变化等方面的影响,引起基金收益水平的变化。

4、通货膨胀风险。如果发生通货膨胀,基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消,从而影响基金资产的保值增值。

5、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。

6、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率上升所带来的价格风险(即利率风险)互为消长。

(二) 信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化,到期不能履行合约进行兑付的风险。另外,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

(三) 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回,致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

(四) 中小企业私募债券投资风险

基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降,可能造成基金财产损失。此外,受市场规模及交易活跃程度的影响,中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险,从而对基金收益造成影响。

(五) 操作风险

操作风险是指基金运作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

(六) 管理风险

在基金管理运作过程中,基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平,如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等,都会影响基金的收益水平。

(七) 合规性风险

合规风险指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者违反基金合同有关规定的风险。

(八) 本基金的特有风险

本基金为灵活配置混合型基金,存在大类资产配置风险,有可能受到经济周期、市场环境或基金管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响,导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平,给基金投资组合的绩效带来风险。本基金在股票选择中强调主题投资策略和成长策略,这种评估具有一定的主观性,将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性,因而存在个股选择风险。

本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。具体为:

1) 市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险;

2) 流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险;

3) 基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险,以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险;

4) 保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险;

5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险;

6) 操作风险是指由于内部流程的不完善,业务人员出现差错或者疏漏,或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

(九) 其它风险

1、在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后,如果投资于这些工具,基金可能会面临一些特殊的风险;

2、因技术因素而产生的风险,如计算机系统不可靠产生的风险;

3、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;

4、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;

5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险;

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) 声明

1、投资者投资于本基金,须自行承担投资风险;

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金代销机构公开发售,基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、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。

3、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。

4、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并公告。

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(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的保存

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。

二十一、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利和义务

(一) 基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 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，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其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；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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。

(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) 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；
- (2) 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；
- (3) 销售基金份额；
- (4) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (5) 依据《基金合同》及有关法律规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；
- (6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (7) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (8) 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；
- (9) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (10) 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；
- (11) 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；

(12) 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、融券；

(13) 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；

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

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

(16) 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) 依法办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金注册或备案手续；

(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，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产或者职务之便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) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、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前提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并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，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托管人追偿；
- (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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (25) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (26) 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，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券、期货账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 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，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 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，不得委托第三人托管基金财产；

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户, 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;
- (7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露;
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见, 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;
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (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管理人、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，基金管理人因违反《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追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改基金合同的重要内容或者提前终止《基金合同》（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额百分之十以上（含百分之十）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）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (3) 在不违反法律法规和基金合同的约定, 且对现有的基金份额持有人利益无实质性影响的前提下, 变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
- (4) 在不违反法律法规和基金合同的约定, 且对现有的基金份额持有人利益无实质性影响的前提下, 增加、减少或调整基金份额类别;
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或《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;
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集的, 由基金托管人召集;
- 3、基金份额持有人大会未设立日常机构的, 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, 应当由基金托管人自行召集, 并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人, 基金管理人应当配合;
- 4、基金份额持有人大会未设立日常机构的, 代表基金份额百分之十以上(含百分之十)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 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, 代表基金份额百分之十以上(含百分之十)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日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

5、基金份额持有人大会设立日常机构的，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额百分之十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，应当向该日常机构提出书面提议。

该日常机构应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金管理人、基金托管人和提出提议的基金份额持有人代表。该日常机构决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；该日常机构决定不召集，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，按照未设立日常机构的相关规定执行。

6、代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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，而基金份额持有人大会的日常机构、基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人大会日常机构、基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

7、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式以及法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前述比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面

形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表

决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（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）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证, 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的, 不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下, 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(若由基金托管人召集, 则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议, 召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决, 在公告基金份额持有人大会决议时, 必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金份额持有人大会日常机构、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。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、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定, 凡是直接引用法律法规的部分, 如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的, 基金管理人提前公告后, 可直接对本部分内容进行修改和调整, 无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为6次, 每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%, 若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权，今后若增加、减少或调整基金份额类别，则同类别内每一份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(二) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(三) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

(四) 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

四、与基金财产管理、运用有关费用的计提、支付方式与比例

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券、期货账户开户费用和银行账户维护费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他

费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

(一) 投资目标

本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略，把握市场机会，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

(二) 投资范围

本基金的投资对象是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）、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货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的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票投资比例范围为基金资产的0-95%；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除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；
- （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全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- （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）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的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

20%;

(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合计规模的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) 基金财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) 本基金投资于股指期货,还应遵循如下投资组合限制:

1) 在任何交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%,持有的卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%;

2) 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;

3) 本基金在任何交易日日终,持有的买入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;

4) 本基金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%;

(17) 基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(18) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需要经过基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二) 基金资产净值、基金份额净值的公告方式

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过其网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

七、基金合同变更和终止事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、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。

3、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。

4、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并公告。
- (7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

(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的保存

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。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对

各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

二十二、基金托管协议的内容摘要

(一) 托管协议当事人

1、基金管理人

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号

法定代表人：井贤栋

成立时间：2004 年11 月8 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2004]164 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币5.143 亿元

存续期限：长期

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、开展特定客户资产管理业务、

中国证监会许可的其他业务

2、基金托管人

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（100032）

法定代表人：姜建清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：赵会军

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

批准设立机关和设立文号：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）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（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：

本基金的投资对象是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）、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货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的相关规定）。

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:

本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种, 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适时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, 基金托管人就本基金投资组合的下列投资限制进行监督:

- a、本基金股票投资比例范围为基金资产的 0%-95%;
- b、本基金每个交易日日终在扣除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;
- c、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%;
- d、本基金管理人管理的且由本协议项下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%;
- e、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%;
- f、本基金管理人管理的且由本协议项下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%;
- g、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%;
- h、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- i、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 20%;
- j、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%;
- k、本基金管理人管理的且由本协议项下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合计规模的10%;

1、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;

m、基金财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;

n、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;

o、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%;

p、本基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之二;本基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过该基金资产净值的百分之十;经基金管理人和托管人协商,可对以上比例进行调整;

q、本基金投资于股指期货,还应遵循如下投资组合限制:

1) 在任何交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%,持有的卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%;

2) 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;

3) 本基金在任何交易日日终,持有的买入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(不含到日期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;

4) 本基金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%;

r、基金总资产不得超过基金净资产的140%。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开

始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需要经过基金份额持有人大会审议。

3) 法规允许的基金投资比例调整期限

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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，便于基金托管人实施交易监督。

4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

(3) 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资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向基金管理人、基金托管人出资。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易

对手的名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人,基金托管人于2个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,基金托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任。

3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿。如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程,则对于由于交易对手资信风险引起的损失,不承担赔偿责任。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核交易对手是否在名单内列明。

(5) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除

核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在书面通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核核心存款银行是否在名单内列明。

(6) 基金托管人对基金投资中小企业私募债券按照证监会《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》等有关法律法规的规定进行监督和核查。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令

前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定,对基金管理人是否遵守法律法规进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投

资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的合理疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

(三) 基金管理人有关基金托管人的业务核查

基金管理人有关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、证券账户和期货账户等投资所需账户、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资金划拨指令、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及时核对确认并以书面形式向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。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,

或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

(四) 基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需的账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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，确保基金财产的完整与独立。

(5) 对于因基金申购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

2、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

资产托管专户的开立和使用，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。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及

银行业监督管理机构的其他规定。

3、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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对方书面同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、债券托管账户的开立和管理

(1)《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和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金管理人 and 基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

5、期货账户的开设和管理

依据相关期货交易所的规定开立和管理期货账户。

6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

8、与基金财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分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

(五) 基金资产净值的计算与复核程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本托管协议的规定暂停估值的除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》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交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人将基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

(六) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基

金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

(七) 争议解决方式

相关各方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,除经友好协商可以解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在北京,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

(八) 托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。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、对账单

投资者可以通过本公司客服电话、网站、电子邮件、短信等通道定制对账单服务。本公司在获得准确邮寄地址、手机号码、电子邮箱的前提下，为已定制账单服务的投资者提供电子或纸制对账单。

（1）电子对账单

投资者登记个人电子邮箱信息后，可定制月度、季度和年度电子账单。电子对账单在每月、季、年度结束后 15 个工作日内向基金持有人指定电子信箱发送。

（2）纸质对账单

基金份额持有人定制纸质对账单后，可获得交易发生期间的季度账单。基金份额持有人在季度内无交易发生，将不邮寄该季度的对账单。定制纸质对账单的基金份额持有人将获得年度对账单。对账单的寄送时间为每季度或年度结束后的 15 个工作日内寄出。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详或因邮局投递差错、通讯故障、延误等原因，造成对账单无法按时准确送达，请及时到原基金销售网点或致电本公司客服中心办理相关信息变更。如需补发对账单，敬请拨打客服热线。

2、其他相关的信息资料

（二）基金间转换服务

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资者办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。

（三）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人可为基金投资者提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短信（因相关方技术系统原因，小灵通用户暂不享有短信服务，待技术系统开发运行成功后，基金管理人

将及时向小灵通用户提供上述服务)、EMAIL 等方式为基金投资者发送所订制的信息,内容包括:交易确认信息、公告信息、投资理财刊物邮件等。

(四) 资讯服务

1、信息查询密码

基金管理人为场外基金份额持有人预设基金查询密码,预设的基金查询密码为投资者开户证件号码的后6位数字,不足6位数字的,前面加“0”补足。基金查询密码用于投资者查询基金账户下的账户和交易信息。投资者请在知晓基金账号后,及时拨打本公司客户服务中心电话或登录本公司网站修改基金查询密码。

2、客户服务电话

投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打本公司客户服务中心电话。

客户服务电话:400-710-9999(免长途话费)

传真:(022)83865563

3、互联网站

公司网址:www.thfund.com.cn

电子信箱:service@thfund.com.cn

(五) 客户投诉处理

投资者可以拨打代销机构和本公司客户服务中心电话投诉直销机构或代销机构的人员和服务。

二十四、其他应披露事项

披露日期	披露事项名称	法定披露媒介
2016年5月9日	天弘基金管理有限公司关于参加中金牛(北京)投资咨询有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年5月30日	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司(认)申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年6月20日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会指定媒介
2016年6月20日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证监会指定媒介
2016年6月24日	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通易宝支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介
2016年7月1日	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在陆金所资管开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年7月1日	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介
2016年7月2日	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介
2016年7月2日	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介
2016年7月19日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证监会指定媒介

2016年7月19日	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在大同证券开通定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介
2016年8月29日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告	中国证监会指定媒介
2016年8月29日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介
2016年8月31日	天弘基金管理有限公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务 以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年9月6日	天弘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开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年9月6日	天弘基金管理有限公司关于增加众升财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年9月6日	天弘基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介

2016年9月7日	天弘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销售机构并开通申购、赎回、转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年10月17日	天弘基金管理有限公司关于增加宜信普泽投资顾问(北京)有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介
2016年10月26日	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证监会指定媒介

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

二十六、备查文件

- (一) 中国证监会准予天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件
- (二) 关于申请天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)变更注册之法律意见书
- (三) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (四) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (五) 《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (六) 《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (七) 注册登记协议
- (八) 中国证监会规定的其他文件

以上第(四)项备查文件存放在基金托管人的办公场所,其他文件存放在基金管理人的办公场所、营业场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

天弘基金管理有限公司
二〇一六年十二月二十一日