

德邦基金管理有限公司关于以通讯方式召开德邦德 信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份 额持有人大会的公告

一、会议基本情况

德邦基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2013]152号文准予注册的德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2013年4月25日生效。本基金的基金份额包括德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“德邦德信基金份额”，基金代码：167701，场内简称“德邦德信”）、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金A份额（以下简称“德信A份额”，基金代码：150133，场内简称“德信A”）、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金B份额（以下简称“德信B份额”，基金代码：150134，场内简称“德信B”）。

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2017 年 4 月 8 日起，至 2017 年 4 月 13 日 17:00 点止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：德邦基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区吴淞路 218 号宝矿国际大厦 35 层

联系人：卞璐璐、邹瑶

联系电话：021-26010947、021-26010870

请在信封表面注明：“德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》（见附件一）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2017 年 4 月 7 日，即在 2017 年 4 月 7 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（含德邦德信基金份额、德信 A 份额和德信 B 份额的基金份额持有人，下同）均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（<http://www.dbfund.com.cn/>）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身

份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理

人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2017 年 4 月 8 日起，至 2017 年 4 月 13 日 17:00 点以前（送达时间以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄的方式送达至本基金管理人办公地址，并在信封表面注明：“德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：德邦基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区吴淞路 218 号宝矿国际大厦 35 层

联系人：卞璐璐、邹瑶

联系电话：021-26010947、021-26010870

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议，使基金份额持有人在本次会议上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金

份额的数额以注册登记机构的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面的授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站

(<http://www.dbfund.com.cn/>) 下载并打印等方式获取授权委托书样本。

1、基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

请参见“四、表决票的填写和寄交方式”中“2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容”的第（3）项及第（4）项内容。

2、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（2）如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权；

(3) 如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（交通银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期（即 2017 年 4 月 13 日后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之前送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的德邦德信基金份额、德信 A 份额和德信 B 份额占基金权益登记日各自份额类别基金总份额的 50%以上(含 50%)；

2、《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》应当由提交有效表决票的德邦德信基金份额、德信 A 份额 与德信 B 份额的基金份额持有人和其代理人在各自份额类别内所持表决权的 2/3 以上(含 2/3，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 2/3 以上)通过；

3、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提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定，并与登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自生效

之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的德邦德信基金份额、德信 A 份额和德信 B 份额达到权益登记日各自份额类别基金总份额的 50%以上(含 50%)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人：德邦基金管理有限公司

联系人：卞璐璐、邹瑶

联系电话：021-26010947、021-26010870

传真：021-26010966

网址：<http://www.dbfund.com.cn/>

2、监督人：交通银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话： 021-62178903

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-821-7788、021-26010928 咨询。

3、本基金的首次停牌时间为本公告刊登日（2017 年 3 月 13 日）开市起至当日 10:30 停牌。本基金第二次停牌时间为基金份额持有人大会计票日（2017 年 4 月 14 日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、基金管理人将在发布本公告后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

5、本公告的有关内容由德邦基金管理有限公司负责解释。

德邦基金管理有限公司

2017 年 3 月 13 日

附件一：《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金

转型及基金合同修改有关事项的议案》

附件二：《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案的说明》

附件一：

关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为更好的维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型及《基金合同》修改事宜，将德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）转型为“德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）”，并对《基金合同》进行修订。基于此次本基金由分级基金转为上市开放式基金

(LOF)事宜，按照现时有效的相关法律法规和中国证监会的有关规定对《基金合同》进行修订，修订内容包括删去基金份额的分级与净值计算规则、场内份额配对转换、份额折算等基金份额分级相关条款，变更基金名称、基金的存续条件、基金份额持有人大会、基金估值、基金的收益与分配、基金合同终止事由以及其他部分条款。修改的具体内容详见附件四《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》。

本次基金转型及《基金合同》修改如获得基金份额持有人大会审议批准，为实施本基金的转型，提议授权基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在转型实施前，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：德邦基金管理有限公司

2017年3月13日

附件二：

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人
大会表决票

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人
大会表决票

基金份额持有人姓名/名称：

证件号码（身份证件号/营业执照号）： 基金账号/证券账号：

审议事项 同意 反对 弃权

《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基
金合同修改有关事项的议案》

基金份额持有人/受托人签名或盖章

2017年 月 日

说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在
相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见；表决意见代表基
金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见；

2、“基金账号”指持有本基金场外德邦德信基金份额的基金账号，
“证券账号”指持有本基金场内德邦德信基金份额、德信 A 份额和
德信 B 份额的证券账号。同一基金份额持有人拥有多个此类账户且
需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金
账号/证券账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无
法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基

金所有份额；

3、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”；

4、本表决票可从本基金管理人网站

(<http://www.dbfund.com.cn/>) 下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生 / 女士或 单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2017 年 4 月 13 日 17:00 点的以通讯方式召开的德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在法定时间内就同一议案重新召开德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本次基金份额持有人大会授权期间本人（或本机构）做出的各类授权依然有效。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人基金账号/证券账号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托日期：2017 年 月 日

附注：1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、“基金账号”指持有本基金场外德邦德信基金份额的基金账户号，“证券账号”指持有本基金场内德邦德信基金份额、德信 A 份额和德信 B 份额的证券账号。同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账号/证券账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金

合同修改有关事项议案的说明

一、重要提示

1、为更好的维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议基金转型及《基金合同》修改事宜，将德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）转型为“德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）”，并对《基金合同》进行修订。

2、本次德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型方案需经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德邦德信基金份额、德信 A 份额和德信 B 份额占基金权益登记日各自份额类别基金总份额的 2/3 以上(含 2/3，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 2/3 以上)同意方可通过，因此转型方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项自表决通过之日起生效，基金管理人自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型方案或本基金的投资价值、市场

前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金”更名为“德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）”。同时，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》将变更为《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》。

（二）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金拟转型为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF），转型后由指数分级基金转为上市开放式基金（LOF），因而不设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制，删去相关内容，包括基金份额的分级与净值计算规则、场内份额的配对转换、基金份额折算、德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易、终止运作等章节以及其他相关条款。

（三）基金份额的转换

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，对德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额进行份额的转换。德邦德信基金份额的场外份额将转换为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）场外 A 类基金份额，德信 A 份额、德信 B 份额将在终止

分级运作后以份额折算基准日德邦德信基金份额的基金份额净值为基准按照各自的基金份额净值折算成德邦德信基金份额的场内份额，德邦德信基金份额的场内份额转换为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）的场内 A 类基金份额。转换完成后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。

德信 A 份额和德信 B 份额的份额折算计算公式：

德信 A 份额（或德信 B 份额）的折算比率 = 份额折算基准日德信 A 份额（或德信 B 份额）的基金份额净值 / 份额折算基准日德邦德信基金份额的基金份额净值

德信 A 份额（或德信 B 份额）基金份额持有人持有的折算后德邦德信基金份额的场内份额数 = 基金份额持有人持有的折算前德信 A 份额（或德信 B 份额）的份额数 × 德信 A 份额（或德信 B 份额）的折算比率

德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额基金份额持有人持有的转型后德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）份额数的具体计算和基金份额转换的具体安排详见基金管理人届时发布的公告。

（四）增加 C 类基金份额

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，就转型后形成的德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）增加收取销售服务费的 C 类基金份额。

新增的销售服务费计提方法、计提标准和支付方式为：

“4、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费自基金合同生效日起每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构或基金管理人，并由登记机构支付或基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。”

（五）转型后 A 类基金份额的上市交易

新增：

“基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以申请本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所上市交易。

一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

二、上市交易的时间

在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，

于基金合同生效后 3 个月内，基金管理人可向深圳证券交易所申请本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所上市交易。

在确定本基金上市交易的时间后，基金管理人应依据有关规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。

A 类基金份额上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统中的 A 类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的 A 类基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记系统后，方可上市交易。

三、上市交易的规则

本基金的上市交易按照深圳证券交易所相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》和相关法律法规以及深圳证券交易所的相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

六、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。

七、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加本基金上市交易方面的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。”

（六）修改基金投资相关内容

1、风险收益特征

原表述：

“从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从两类份额看，德信 A 份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率+1.20%，表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。德信 B 份额获得剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险较高，预期收益相对较高的特点。”

修改为：

“本基金为债券型基金，从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金，主要采取抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。”

2、投资范围

原表述：

“本基金的投资范围为主要投资于债券，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及中国证监会

允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

此外，本基金也可投资于银行定期存款、通知存款、大额存单等具有良好流动性的货币市场工具。本基金不投资股票（含一级市场新股申购）、权证和可转换公司债券（不含可分离交易可转债的纯债部分）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于债券资产净值的 80%。”

修改为：

“本基金的投资范围为主要投资于债券，包括国内依法发行上市的国债、中央银行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。此外，本基金也可投资于银行定期存款、同业存单以及具有良好流动性的货币市场工具。本基金不投资股票、权证和可转换公司债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%。”

3、投资策略

新增：“4、中小企业私募债券投资策略

对于中小企业私募债券而言，由于其采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，会导致一定的流动性风险。同时，中小企业私募债券的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，进而整体的信用风险相对较高。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中将从以下三个方面控制投资风险。首先，本基金将仔细甄别发行人资质，建立风险预警机制；其次，将严格控制中小企业私募债券的投资比例上限。第三，将对拟投资或已投资的品种进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产证券化产品的质量 and 构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。”

（七）修改基金资产的估值

1、估值对象

原表述：“基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

修改为：“基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

2、估值方法

原表述：“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，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、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。

.....

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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。”

修改为：

“1、证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券，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、交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

(2)对在交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值;

(3)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,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;

(4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1)银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的固

定收益品种，按成本估值。

4、首次公开发行未上市的债券，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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按该债券所处的市场分别估值。

6、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。

.....

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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，基金托管人不负责赔付。”

3、鉴于转型后不再进行基金份额分级，基金资产的估值程序、基金份额净值估值错误处理的方法、基金净值的确认也一并进行修改。

（八）修改基金的费用

将基金管理人的管理费年费率由 0.70%调整为 0.50%，托管费的年费率由 0.20%调整为 0.15%。

（九）修改基金的收益与分配原则

原表述：“本基金（包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信

B 份额) 不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止德信 A 份额与德信 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。”

修改为：

“1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

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、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取

销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的每一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。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。”

（十）删去《基金合同》“第五部分 基金份额的发售”、“第六部分 基金备案”等与基金募集发售及基金备案的相关内容，并就“基金的历史沿革”、“基金的存续”单设章节。

（十一）本次基金转型及基金合同修改如获得基金份额持有人大会审议批准，为了基金转型期间平稳运作，基金管理人提请基金份额持有人大会同意，在基金份额持有人大会决议生效日起至基金转型实施日止的期间，本基金的债券投资比例可不受《基金合同》约定的“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于债券资产净值的 80%。”的比例限制。

（十二）其他修改内容

为使《基金合同》适应新的法律法规要求和业务需要，在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改。具体修改内容见本说明之附件。

（十三）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，自基金转型实施日起生效，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基本情况
德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2013]152号文）准予募集，基金管理人为德邦基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金自2013年3月25日至2013年4月19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，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》于2013年4月25日

生效。

（二）德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型法律方面的可行性

本基金由分级基金转型为上市开放式基金（LOF），不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制，删去基金份额的分级、场内份额的配对转换、基金份额折算、德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易、终止运作等基金份额分级相关条款，变更基金名称、基金份额持有人大会、基金投资、基金估值、基金的收益与分配以及其他部分条款。本次对《基金合同》的修改事宜属于《基金合同》第十一部分基金份额持有人大会规定的“对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项”，根据《基金合同》第二十四部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“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。”且本次基金份额持有人大会决议按特殊决议处理，须经参加大会的德邦德信基金份额持有人、德信 A 份额持有人、德信 B 份额持有人或其各自代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可生效。因此，本次基金转型相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

（三）基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，经与基金托管

人的沟通和协作，做好了基金转型的相关准备。本次基金转型不存在技术方面的障碍。

（四）基金管理人修订合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

（一）预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对转型方案进行适当修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如转型方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的转型方案议案。

（二）预防基金转型后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

（三）基金转型后遭遇大规模赎回的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金将尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

在全部基金份额均被赎回的情形下，本基金将进入财产清算程序。

（四）预防及控制基金转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，对于基金转型过程中可能发生的较大规模的申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。

五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人：德邦基金管理有限公司客服中心

联系电话：400-821-7788，021-26010928

传真：021-26010960

网站：www.dbfund.com.cn

附件：

一、基金合同修改如下：

原合同条款 修改后条款

全文 德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金 德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）

全文 注册登记机构、注册登记 登记机构、登记

全文 媒体 媒介

全文 书面表决意见、书面意见 表决意见

前言 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（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》”）和其他有关法律法规。 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）和其他有关法律法规。

前言 三、证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

三、德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）由德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型而来。德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金募集的核准及转型为本基金的变更注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

.....

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。

前言 五、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

释义 4、基金合同或本基金合同：指《德邦德信中证中高收益企债指数分级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

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《德邦德信中证中高收益企债指数分级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

6、招募说明书：指《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书：指《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金之德信 A 份额与德信 B 份额上市交易公告书》

4、基金合同或本基金合同：指《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期的更新

7、上市交易公告书：指《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额上市交易公告书》

释义 10、《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，自 2004 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

11、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 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

13、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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 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，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务

委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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

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

释义 16、基金份额结构：本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额是基金组合份额，简称“德邦德信基金份额”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“德信 A”）和积极收益类份额（简称“德信 B”）。德信 A 与德信 B 的基金份额配比始终保持 7：3 的比例不变

17、德邦德信基金份额：指德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金之基础份额

18、德信 A 份额：指获取稳健收益的基金份额，即德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金之 A 份额

19、德信 B 份额：指获取积极收益的基金份额，即德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金之 B 份额

释义 23、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境

外的机构投资者

24、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

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暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于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、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金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

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币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

释义 27、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理德邦德信基金份额认购、申购和赎回等业

务的基金销售机构及其场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

28、场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理德邦德信基金份额认购、申购、赎回以及德信 A 份额与德信 B 份额上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

23、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额申购和赎回等业务的基金销售机构及其场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

24、场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回分别称为场内申购、场内赎回

释义 29、直销机构：指德邦基金管理有限公司

30、场外代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，代为办理场外基金销售业务的机构

31、场内代销机构：指代为办理场内基金销售业务，具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位

32、代销机构：除特别说明外，指场外代销机构和场内代销机构的合称

33、销售机构：指本基金的直销机构和代销机构 25、销售机构：指德邦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，以及经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位

释义 34、注册登记业务：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

35、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

36、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

37、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统 26、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

29、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统

释义 30、场外份额：指登记在登记结算系统下的基金份额

31、场内份额：指登记在证券登记系统下的基金份额

释义 38、基金账户：指基金投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录投资人持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。基金投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

39、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

40、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 32、开放式

基金账户：指基金投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录投资人持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。基金投资人办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的登记结算系统

33、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的证券登记系统

34、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办理申购、赎回、交易、转换、转托管及定期定额投资等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

释义 41、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

43、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

44、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 35、基金合同生效日：指基金管理人公告的德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）的实施日期，《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并经 XX 年 XX 月 XX 日德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，自基金转型实施起生效，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》自同一起失效

37、存续期：指《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》生效至《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》终止之间的不定期期限

释义 50、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所交易规则》及不时作

出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及不时作出的修订

43、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》及不时作出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及不时作出的修订

释义 51、认购：指在基金募集期内，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

释义 54、上市交易：指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖德信 A 份额、德信 B 份额的行为

55、场内份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的德邦德信基金份额的场内份额与德信 A 份额、德信 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

56、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 10 份德邦德信基金份额的场内份额申请转换成 7 份德信 A 份额与 3 份德信 B 份额的行为

57、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 7 份德信 A 份额与 3 份德信 B 份额进行配对申请转换成 10 份德邦德信基金份额的场内份额的行为

58、基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的约定，对本基金

所有份额进行折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为

1.000 元的行为

60、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行为

61、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

62、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

63、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基金申购申请的一种投资方式

64、巨额赎回：指本基金单个开放日，德邦德信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)超过上一开放日基金总份额（包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额）的 10% 46、上市交易：指基金合同生效后投资人通过交易所会员单位以集中竞价的方式买卖场内基金份额的行为

48、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行为，包括系统内转托管和跨系统转托管

49、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

50、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为

51、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申购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

52、巨额赎回：指本基金单个开放日，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）超过上一开放日基金总份额的 10%

释义 54、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

55、A 类基金份额：指在投资人申购、赎回基金时收取申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C 类基金份额：指在投资人申购基金时不收取申购费用，赎回时收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

释义 66、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

67、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 57、基金收益：指基金投资所得债券利息、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

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

释义 71、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体 62、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

基金的基本情况 一、基金名称

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金

.....

六、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

七、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费率最高不超过 5%，具体费率由基金管理人决定，并在

按招募说明书中列示。 一、基金名称

德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）

.....

六、基金份额面值

本基金基金份额面值为人民币 1.00 元。

.....

八、基金份额的类别

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用，在赎回时根据持有

期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规和基金合同且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商，在履行适当程序后，本基金可停止现有基金份额类别的销售，增加新的基金份额类别，或调整现有基金份额的金额限制、调低销售服务费等，或对基金份额分类办法及规则进行调整，该等调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会审议。

基金份额的分级 第四部分 基金份额的分级

一、基金份额结构

本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“德邦德信基金份额”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类：稳健收益类份额（简称“德信 A 份额”）和积极收益类份额（简称“德信 B 份额”）。德信 A 份额及德信 B 份额的基金份额配比始终

保持 7：3 的比例不变。

二、基金运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售德邦德信基金份额。投资人场外认购所得的份额，将被确认为德邦德信基金份额。投资人场内认购所得的份额，将按 7：3 的基金份额配比分拆为德信 A 份额与德信 B 份额。基金合同生效后，投资人认购所得的德邦德信基金份额场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

2、德信 A 份额、德信 B 份额与德邦德信基金份额的资产合并投资运作。

3、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，对德邦德信基金份额开放场外申购、场外赎回及场内申购、场内赎回，不对德信 A 份额或德信 B 份额单独开放场内申购、场内赎回。根据基金合同约定，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，德信 A 份额和德信 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

4、基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，办理德邦德信基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人可将其场内申购的德邦德信基金份额，按 7:3 的基金份额配比，申请分拆为德信 A 份额及德信 B 份额；或基金份额持有人，可将其持有的德信 A 份额和德信 B 份额按 7：3 的基金份额配比，申请合并为德邦德信基金份额的场内份额。场外的德邦德信基金份额不进行

份额配对转换。场外的德邦德信基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的德邦德信基金份额配对转换规则进行操作。

5、基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，对德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额进行基金份额折算。除分级份额终止运作的份额折算外，基金份额折算后，本基金的运作方式及德信 A 份额与德信 B 份额的份额配比不变。

三、分级份额的份额净值计算概要

本基金分别计算并公告德邦德信基金份额与德信 A 份额、德信 B 份额的基金份额净值。

1、德邦德信基金份额的基金份额净值计算

德邦德信基金份额的基金份额净值计算公式为：

$$T \text{ 日德邦德信基金份额的基金份额净值} = T \text{ 日闭市后的基金资产净值} / T \text{ 日本基金的基金份额（包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额）余额总数}$$

2、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额净值计算

(1) 本基金 7 份德信 A 份额与 3 份德信 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的份额净值之和等于 10 份德邦德信基金份额的份额净值之和。

(2) 德信 A 份额的约定收益率为一年期银行存款利率加上 1.2%。其中“一年期银行定期存款利率”指基金合同生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率。

德信 A 份额的约定年收益率除以 365 为德信 A 份额的约定日简单收益率。德信 A 份额的份额净值以基金合同生效日或折算日 1 元净值为基准采用德信 A 份额的约定日简单收益率单利进行计算。

基金管理人不承诺也不保证德信 A 份额的基金份额持有人获得约定基准收益或不亏损。在本基金出现极端损失的情形下，德信 A 份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定基准收益，也可能遭受本金损失的风险。

(3) 德信 B 份额的份额净值根据德邦德信基金份额的份额净值、德信 A 份额的份额净值以及德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额的份额净值关系计算。

(4) 如果根据上述计算规则计算出来的德信 B 份额的份额净值小于或等于 0.400 元，或者自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年且期间每个工作日德信 B 份额的份额净值都大于 0.400 元的，则基金管理人将根据基金合同约定，对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到 1.000 元。

(5) 德信 A 份额、德信 B 份额折算日折算后份额净值都调整为 1.000 元，折算后德信 A 份额、德信 B 份额的份额净值计算方法保持不变。

(6) 德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额净值计算公式
假设上一折算日后第 t 个自然日，德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额净值分别为 NAV_t 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ ，上一折算日次日的一年期银行定存利率为 R 。则第 t 个自然日，德信

A 份额与德信 B 份额的基金份额净值计算如下：

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 1.2\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.7 \times NAV(A)_t) / 0.3$$

四、基金份额折算概要

除分级份额终止运作的份额折算外，本基金的基金份额折算分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

1、基金份额的到期折算和到点折算

(1) 基金份额的到期折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年的最后工作日止，如果期间每个工作日德信 B 份额的份额净值都大于 0.400 元，则最后工作日为到期折算日。在到期折算日实施的基金份额折算为基金份额到期折算。

(2) 基金份额到点折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年的最后工作日止，如果期间某个工作日德信 B 份额的份额净值小于或等于 0.400 元，则该日后的第二个工作日为到点折算日。在到点折算日实施的基金份额折算为基金份额到点折算。

2、基金份额折算方法概要

基金份额到期折算和基金份额到点折算的折算方法一致，均按以下方法在基金份额折算日对所有基金份额进行折算：

(1) 德邦德信基金份额的份额折算

基金份额折算日折算后，德邦德信基金份额的基金份额净值折算调

整为 1.000 元。折算后，德邦德信基金份额持有人持有的德邦德信基金份额的份额数按照德邦德信基金份额折算比例相应增加、缩减或不变。若折算前，德邦德信基金份额净值大于 1.000 元，则折算后德邦德信基金份额持有人持有的德邦德信基金份额增加；若折算前，德邦德信基金份额净值小于或等于 1.000，则折算后德邦德信基金份额持有人持有的德邦德信基金份额缩减或不变。

(2) 德信 A 份额与德信 B 份额的份额折算

基金份额折算日折算后，德信 A 份额与德信 B 份额按照折算前各自的基金份额净值折算为净值为 1.000 元的德邦德信基金份额的场内份额，具体折算公式如下：

德信 A (B) 份额的折算比例 = 折算日折算前德信 A (B) 份额的基金份额净值 / 1

德信 A (B) 份额折算为净值为 1.000 元的德邦德信基金份额数量 = 折算前德信 A (B) 份额数量 × 德信 A (B) 份额的折算比例

德信 A 份额、德信 B 份额折算成的德邦德信基金份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

(3) 折算后德邦德信基金份额场内份额的分拆

在基金份额折算后，将德邦德信基金份额的场内份额按照 7:3 的比例分拆成德信 A 份额与德信 B 份额。届时，分拆后的德信 A 份额、德信 B 份额与德邦德信基金份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。

3、分级份额终止运作后的份额折算

德信 A 份额与德信 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，德信 A 份额、德信 B 份额将全部折算成场内德邦德信基金份额。

有关本基金基金份额折算，详见基金合同第二十部分、第二十一部分的约定。 删去。

基金的历史沿革 第五部分 基金份额的发售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资人场外认购所得的全部份额将确认为德邦德信基金份额；投资人场内认购所得的全部份额将按 7：3 的基金份额配比自动分拆为德信 A 份额与德信 B 份额。

场外将通过直销机构及场外代销机构的营业网点（各销售机构的具体名单见基金份额发售公告）公开发售。场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售。尚未取得基金代销业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金德信 A 份额与德信 B 份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，认购费率不得超过 5%。

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。多次认购的认购费按每笔认购申请单独计算。

2、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算

(1) 基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。最终认购的份额是认购金额扣除了认购费的净认购金额加上认购资金相应利息后计算所得，具体计算公式以招募说明书为准。

(2) 基金场内认购采用份额认购的方式, 认购期利息折算为德邦德信基金份额。具体计算公式以招募说明书为准。

(3) 本基金具体认购费率及认购份额计算详见本基金的招募说明书和基金份额发售公告。

4、认购份额余额的处理方式

场外认购份额的计算保留到小数点后 2 位, 小数点 2 位以后的部分四舍五入, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时, 需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔场外最低认购金额、场内最低认购份额进行限制, 具体限制请参看招募说明书。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的场外累计认购金额、场内累计认购份额进行限制, 具体限制和处理方法请参看招募说明书。

第四部分 基金的历史沿革

德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金 (LOF) 由德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型而来。

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金经 2013 年 2 月 17 日中国证监会证监许可[2013]152 号文准予募集, 基金管理人为德邦基金管理有限公司, 基金托管人为交通银行股份有限公司。经中国证监会书面确认, 《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 25 日生效。

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金以 XX 方式召开基金份额持有人大会，大会于 XX 年 XX 月 XX 日表决通过了《关于德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，内容包括德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金终止分级份额的运作、调整投资范围、基金费用、收益分配方式、由指数分级基金变更为上市开放式基金、并更名为“德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）”以及修改其他部分条款，授权基金管理人办理本次基金转型及基金合同修改的具体事宜。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 XX 年 XX 月 XX 日正式实施基金转型，自基金转型实施日起，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》失效且《德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金正式变更为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）。

基金的存续 第六部分 基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资

报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。 第五部分 基金的存续

一、基金份额的变更登记

基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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。

基金份额的上市交易 第七部分 德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易

一、 德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的德信 A 份额与德信 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易。基金份额上市后，投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖德信 A 份额和德信 B 份额。

1、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所

德信 A 份额与德信 B 份额上市后，登记在证券登记结算系统中的德信 A 份额与德信 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的德邦德信基金份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成德信 A 份额与德信 B 份额后，方可上市交易。

2、上市交易的时间

德信 A 份额与德信 B 份额在基金合同生效后 3 个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒体上刊登公告。

3、上市交易的规则

(1) 德信 A 份额与德信 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；

(2) 德信 A 份额与德信 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一工作日德信 A 份额 与德信 B 份额的基金份额净值；

(3) 德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

4、上市交易的费用

德信 A 份额与德信 B 份额上市交易的费用，按照深圳证券交易所上市开放式基金的有关规定办理。

5、上市交易的行情提示

德信 A 份额与德信 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通

过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示德信 A 份额与德信 B 份额前一交易日的份额净值。

6、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

德信 A 份额与德信 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

7、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。 第六部分 基金份额的上市交易

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以申请本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所上市交易。

一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

二、上市交易的时间

在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，于基金合同生效后 3 个月内，基金管理人可向深圳证券交易所申请本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所上市交易。

在确定本基金上市交易的时间后，基金管理人应依据有关规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。

A 类基金份额上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统中的 A 类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的 A 类基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记系统后，方可上市交易。

三、上市交易的规则

本基金的上市交易按照深圳证券交易所相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》和相关法律法规以及深圳证券交易所的相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

六、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。

七、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加本基金上市交易方面的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

基金份额的申购、赎回 第八部分 德邦德信基金份额的申购、赎回

一、德邦德信基金份额申购和赎回场所

德邦德信基金份额的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及场外代销机构的营业网点（各销售机构的具体名单见基金份额发售公告）办理德邦德信基金份额的场外申购和赎回业务。基金投资人也可使用深圳证券账户，通过场内代销机构利用深圳证券交易所交易系统办理德邦德信基金份额的场内申购和赎回业务。具体的销售机构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代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。基金投资者应当在销售机构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、德邦德信基金份额申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，投资人在开放日办理德邦德信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体上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理德邦德信基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其德邦德信基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、德邦德信基金份额申购与赎回的原则

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

.....

4、场外赎回遵循“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；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理德邦德信基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

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体上公告。

四、德邦德信基金份额申购与赎回的程序

.....

投资人在提交申购德邦德信基金份额申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的德邦德信基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购德邦德信基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

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。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

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，本基金注册登记机构在 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）到销售机构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、赎回的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

五、德邦德信基金份额申购和赎回的数量限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

六、德邦德信基金份额申购和赎回的价格、费用及其用途

1、德邦德信基金份额的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 日的德邦德信基金份额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。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：德邦德信基金份额申购份额的计算详见招募说明书。德邦德信基金份额申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的德邦德信基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，场外申购的份额计算结果均按四舍五入方法，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。场内申购的份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

3、赎回金额的计算及处理方式：德邦德信基金份额赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日德邦德信基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，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。

4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

5、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。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6、德邦德信基金份额的申购费用最高不超过 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

7、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、拒绝或暂停申购的情形

.....

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，从而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 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停

接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

.....

- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金会计系统、注册登记系统或证券结算登记系统无法正常运行；
- 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，并以后续开放日的德邦德信基金份额净值

为依据计算赎回金额。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。

九、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德邦德信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(包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 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。

.....

(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(包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额)的 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德邦德信基金份额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。当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。

(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，并应当在指定媒体上进行公告。

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 2 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

十、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体上刊登暂停公告。

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，德邦德信基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登德邦德信基金份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的德邦德信基金份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次；当连续暂停时间超过 2 个月时，刊登暂停公告的频率由基金管理人视情况调整。暂停结束，德邦德信基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的德邦德信基金份额的基金份额净值。

.....

十三、基金的转托管

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场内认（申）购的德邦德信基金份额或上市交易买入的德信 A 份额、德信 B 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下；场外认（申）购的德邦德信基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

2、系统内转托管

系统内转托管是指基金持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位

（交易单元）之间进行转托管的行为。基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理德邦德信基金份额场外基金赎回业

务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。

基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理德信 A 份额与德信 B 份额上市交易或德邦德信基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的德邦德信基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

.....

十五、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。

第七部分 基金份额的申购、赎回

一、申购和赎回场所

本基金场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位；本基金场外申购和赎回场所为基金管理人直销机构和其他场外销售机构。

本基金场外、场内销售机构名单将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。在本基金基金合同生效后，投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回本基金 A 类基金份额；通过场外渠道申购与赎回本基金 C 类基金份额。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。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回或转换的价格。

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；

.....

4、场外的基金份额赎回遵循“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；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行；

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

.....

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

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；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；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。遇证券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它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，则赎回款顺延至下一个工作日划出。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。

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）及时到销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

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、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

4、在法律法规允许的范围内，登记机构可对上述业务内容进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

五、申购和赎回的数量限制

- 1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。
- 2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。
- 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。
- 4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。
- 5、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、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限等。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、申购和赎回的价格、费用及其用途

- 1、本基金分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。投资人在申购、赎回 A 类基金份额时支付申购费用、赎回费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，赎回 C 类基金份额时收取赎回费用，并从该类别基金资产中计提销售服务费。
- 2、本基金各类基金份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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，经中国证监会同意或根据基金合同的约定，可以适当延迟计算或公告。

3、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金各类基金份额申购份额的计算详见招募说明书。本基金A类基金份额申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，场外申购的份额计算结果均按四舍五入方法，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。场内申购的份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金A类基金份额和C类基金份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，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。

5、本基金A类基金份额申购费用由申购该类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。

6、本基金赎回费用由赎回该类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。赎回费用归入基金财产的比例在招募说明书中列示，未归入基金财产的部分用于支付登记费和

其他必要的手续费。

7、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

8、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，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销售费用。

.....

七、拒绝或暂停申购的情形

.....

4、接受某笔或某些申购申请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，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、登记结算系统、证券登记系统或基金会计系统

无法正常运行。

7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

8、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、7、8 项暂停申购情形之一的且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

.....

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、接受某笔或某些赎回申请将会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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，对于场外的赎回申请，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。当出现暂停赎回

或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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。

九、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、巨额赎回的场外处理方式

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对场外赎回申请接受全额赎回或部分延期赎回。

.....

（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的 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 个工作日以上（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；已经确认成功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、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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、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

各类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，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 个开放日各类基金份额的基金份额净值。

.....

十三、基金份额的登记和转托管

1、基金份额的登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购或通过跨系统转托管从场内转入的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购或通过跨系统转托管从场外转入的基金份额或上市交易买入的基金份额登记在证券登记系统基金份额持

有人深圳证券账户下。

(2) 登记在证券登记系统中的基金份额可以直接申请场内赎回，也可以在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的基金份额可以直接申请场外赎回。

2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（交易单元）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

(2) 跨系统转托管仅适用于本基金 A 类基金份额，本基金 A 类基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

.....

十五、基金份额的冻结和解冻

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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。

十六、基金份额转让

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通过其他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，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。

十七、基金份额的质押或其他业务

如相关法律法规允许登记机构办理基金份额的质押业务或其他基金业务，登记机构有权制定和实施相应的业务规则。

基金的份额配对转换 第九部分 基金的份额配对转换

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的德邦德信基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。

一、场内份额配对转换

1、场内份额配对转换：指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。

2、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 10 份德邦德信基金份额的场内份额申请转换成 7 份德信 A 份额与 3 份德信 B 份额的行为。

3、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 7 份德信 A 份额与 3 份德信 B 份额进行配对申请转换成 10 份德邦德信基金份额的场内份额的行为。

4、场外的德邦德信基金份额不进行份额配对转换。在场外德邦德信基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

二、业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人，应当在场内份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式，办理场内份额配对转换。深圳证券交易所、注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

三、业务办理时间

场内份额配对转换，自德信 A 份额、德信 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理该业务前在指定媒体上予以公告。

四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行分拆的德邦德信基金份额的场内份额必须是 10 的整数

倍。

3、申请进行合并的德信 A 份额与德信 B 份额必须同时配对申请，德信 A 份额与德信 B 份额必须为正整数且两者的比例须为 7:3。

4、德邦德信基金份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为德邦德信基金份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在指定媒体公告。

五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

六、暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人有权根据市场情况，暂停配对转换的合并或分拆。

2、深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述三项的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒体公告。

七、份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可按照规定的标准收取一定的佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。 删去。

基金合同当事人及权利义务 2、基金管理人的权利与义务

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

1) 依法募集基金；

.....

5) 召集基金份额持有人大会；

.....

9) 担任或委托其他符合条件的机构担任注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；

.....

11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理德邦德信基金份额的申购与赎回申请；

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

13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；

.....

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

17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

1) 依法募集基金，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发售、申购、赎回和登记事宜；

.....

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定德邦德信基金份额的申购、赎回的价格；

.....

14) 按规定受理德邦德信基金份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

.....

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

2、基金管理人的权利与义务

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

1) 依法募集资金;

.....

5) 按照规定召集基金份额持有人大会;

.....

9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用, 若委托其他机构办理登记业务的, 应对委托的基金登记机构办理基金登记的行为进行监督;

.....

11) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

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

13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资;

.....

16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、上市交易和非交易过户等业务业务规则;

17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

1) 依法募集资金, 办理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销售、申购、赎回和登记事宜;

.....

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，确定基金份额的申购、赎回的价格；

.....

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

基金合同当事人及权利义务 2、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：

.....

4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

.....

7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(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：

.....

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照本合同及托管协议的约定，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、德邦德信基金份额的申购、赎回价格;

.....

12) 建立并保存基金份额持有人名册;

.....

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业监督管理机构, 并通知基金管理人;

.....

德邦德信基金份额、德信 A 份额 及德信 B 份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果德信 A 份额与德信 B 份额的运作出现终止, 则在终止德信 A 份额与德信 B 份额的运作后, 本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

2、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:

.....

4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户, 为基金办理证券交易资金清算;

.....

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：

.....

6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照基金合同及托管协议的约定，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，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额的申购、赎回价格；

.....

12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

.....

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业监督管理机构，并通知基金管理人；

.....

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

基金合同当事人及权利义务 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：

.....

(3) 依法转让其持有的德信 A 份额与德信 B 份额，依法申请赎回其

持有的德邦德信基金份额，依法申请进行基金份额的配对转换；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

.....

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

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；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

.....

(4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用； 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：

.....

(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；

.....

(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或仲裁；

(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；

.....

(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

基金份额持有人大会 一、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。 一、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

基金份额持有人大会 二、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：

.....

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

.....

(10) 终止德信 A 份额与德信 B 份额的运作；

(11) 终止德信 A 份额与德信 B 份额上市交易，但因德信 A 份额与德信 B 份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(13) 代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%，每一级份额均应占各该级份额总数的 10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额的 10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人）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）提议时，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

.....

(15) 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；

.....

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整德邦德信基金份额的申购费率、调低德邦德信基金份额的赎回费率、变更或新增收费方式；

(4) 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) 根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改德信 A 份额与德信 B 份额的上市与交易规定；

(7) 在不变更本基金合同其他约定的条件下，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更德邦德信基金份额的收益分配方式；

(8) 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、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，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

.....

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；

.....

(11) 终止 A 类基金份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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；

.....

(14) 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、在法律法规规定和基金合同约定的范围内，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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) 调低销售服务费；

.....

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

.....

(6) 在不损害已有基金份额持有人权益的情况下增加、取消或调整基金份额类别设置；

(7) 基金管理人、登记机构、深圳证券交易所、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 在法律法规或中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；

(9) 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其他情形。

基金份额持有人大会 三、会议召集人及召集方式

3、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。

4、代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%，每一级份额均应占各该级份额总数的 10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额总数的 10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本合同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持

有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

三、会议召集人及召集方式

3、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、代表基金份额 10%以上（含 10%）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 10%以上（含 10%）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、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召

集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）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，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

基金份额持有人大会 五、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等方式召开，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：

.....

(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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%，全部有效凭证所对应的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额分别占权益登记日德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各自基金总份额 50%以上，下同）。

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：

.....

(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不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

(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，并与注册登记机构记录相符；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络

等方式召开，且除纸面授权外，基金份额持有人的授权亦可根据召集人在大会通知中规定的方式，通过电话、网络等方式进行。

六、议事内容与程序

(2) 基金管理人、基金托管人、持有德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各自的基金份额总数 10%以上（以权益登记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人，可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合计代表德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（以权益记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额持有人和代理人所持各自类别内的表决权 50%以上（含 50%）选举产生的

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。

.....

七、表决

德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的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德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 50%以上）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德邦德信基金份额、德信 A 份额 与德信 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 2/3 以上，下同）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、终止德信 A 份额与德信 B 份额的运作、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

.....

4、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。

.....

九、生效与公告

1、基金份额持有人大会的决议（包括一般决议和特别决议），召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

2、基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。 五、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、通讯开会方式等法律法规或监管机构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：

.....

(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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二

分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金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会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

.....

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的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表决意见或授权他人代表出具表决意见；

.....

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、

受托出具表决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书证明符合法律法规、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、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决；除纸面授权外，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中载明。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。

六、议事内容与程序

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八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二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人或代理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。

.....

七、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。除基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以及与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

.....

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为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，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

.....

九、生效与公告

1、基金份额持有人大会的决议（包括一般决议和特别决议），召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

2、基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

.....

十、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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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。

基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 1、基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

.....

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

.....

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过。新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

.....

(4) 核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行；

(5) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后 2 日内在指定媒体公告；

(6) 交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；

(7) 审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(8) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理

人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过。新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

.....

(4) 核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后后方可执行；

(5) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后 2 日内在指定媒体公告；

(6) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；

(7) 审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报

中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

三、基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有德邦信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

.....

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

四、新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

1、基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

.....

（4）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形。

2、基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

.....

（4）法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他情形

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人及其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过。新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

.....

(4) 备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案；

(5) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告；

(6) 交接：原任基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；

(7) 审计：原任基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(8) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关

的名称字样。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人及其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过。新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

.....

(4) 备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；

(5) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告；

(6) 交接：原任基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；

(7) 审计：原任基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同

时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

三、基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

.....

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 个工作日内在指定媒介上联合公告。

四、新基金管理人接受基金管理业务或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

五、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

基金份额的登记 三、基金注册登记机构的权利

基金注册登记机构享有以下权利：

.....

2、建立和管理投资者基金账户；

.....

4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒体上公告；

5、法律法规规定的其他权利。

四、基金注册登记机构的义务

基金注册登记机构承担以下义务：

.....

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录15年以上；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；

.....

7、法律法规规定的其他义务。 三、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

.....

2、建立和管理投资者开放式基金账户和/或深圳证券账户；

.....

4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间和相关业务规则进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；

5、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。

四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

.....

3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于二十年；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形除外；

.....

7、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。

基金的投资 二、投资范围

本基金的投资范围为主要投资于债券，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、

中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

此外，本基金也可投资于银行定期存款、通知存款、大额存单等具有良好流动性的货币市场工具。本基金不投资股票（含一级市场新股申购）、权证和可转换公司债券（不含可分离交易可转债的纯债部分）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于债券资产净值的 80%。

.....

四、投资策略

1、资产配置策略

本基金将不低于基金资产净值的 90%投资于债券资产，又将不低于债券资产净值的 80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好, 收益较高的固定收益类产品, 以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上, 具有较好的流动性。并且基金管理人在履行相应程序后可以投资相关法律法规允许的金融衍生工具, 以更好得实现基金的投资目标。

.....

五、投资限制

1、组合限制

(1) 本基金的投资比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于债券资产净值的 80%；

.....

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。

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。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。

.....

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：

.....

(2) 向他人贷款或者提供担保；

.....

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

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

.....

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

.....

六、业绩比较基准

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

七、风险收益特征

从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从两类份额看，德信 A 份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率+1.20%，表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。德信 B 份额获得剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险较高，预期收益相对较高的特点。

二、投资范围

本基金的投资范围为主要投资于债券，包括国内依法发行上市的国债、中央银行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。此外，本基金也可投资于银行定期存款、同业存单以及具有良好流动性的货币市场工具。本基金不投资股票、权证和可转换公司债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%。

四、投资策略

1、资产配置策略

本基金将不低于基金资产净值的 90%投资于债券资产，又将不低于非现金基金资产的 80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好，收益较高的固定收益类产品，以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上，具有较好的流动性。并且基金管理人在履行相应程序后可以投资相关法律法规允许的金融衍生工具，以更好

得实现基金的投资目标。

.....

4、中小企业私募债券投资策略

对于中小企业私募债券而言，由于其采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，会导致一定的流动性风险。同时，中小企业私募债券的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，进而整体的信用风险相对较高。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中将从以下三个方面控制投资风险。首先，本基金将仔细甄别发行人资质，建立风险预警机制；其次，将严格控制中小企业私募债券的投资比例上限。第三，将对拟投资或已投资的品种进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产证券化产品的质量 and 构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

五、投资限制

1、组合限制

(1) 本基金的投资比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 90%。其中，投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低

于非现金基金资产的 80%;

.....

(10) 本基金总资产不得超过本基金净资产的 140%;

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%;

.....

除上述第(8)项另有约定外, 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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, 本基金的投资范围、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。

.....

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:

.....

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

.....

(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;

.....

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

六、业绩比较基准

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金

管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

七、风险收益特征

本基金为债券型基金，从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金，主要采取抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

基金资产估值 二、估值对象

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

三、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，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、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。

.....

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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、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，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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。

五、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。

.....

(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；

.....

六、暂停估值的情形

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时；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

.....

七、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，

由基金管理人对外公布。二、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券，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、交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去

可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

4、首次公开发行未上市的债券，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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按该债券所处的市场分别估值。

6、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。

.....

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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，基金托管人不负责赔付。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 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各类基金份额的基金份额净值，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，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

五、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 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

.....

(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并报中国证监会备案；

.....

六、暂停估值的情形

七、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各类基金份额的基金份额净值

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。

八、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 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

基金费用与税收 一、基金费用的种类

.....

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

.....

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 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

.....

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 5 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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

.....

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 5 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。

3、标的指数使用许可费

~

指数使用许可费每日计提，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元，基金设立当年，不足三个月的，按照三个月收费。

.....

上述“一、基金费用的种类中第4—10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：

.....

3、基金合同生效前的相关费用； 一、基金费用的种类

.....

4、销售服务费；

.....

6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

.....

11、基金的相关账户的开户及维护费用；

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 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50 \% \div \text{当年天数}$$

.....

基金管理费自基金合同生效日起每日计算，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 5 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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

.....

基金托管费自基金合同生效日起每日计算，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 5 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。

3、标的指数使用许可费

.....

指数使用许可费每日计提，按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金资产中一次性支付给标的指数许可方。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元，基金设立当年，不足三个月的，按照三个月收费下限收费。

.....

4、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费自基金合同生效日起每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构或基金管理人，并由登记机构支付或基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。上述“一、基金费用的种类”中第 5—12 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，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

.....

3、《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》生效前的相关费用；

.....

四、本基金由德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型而来，基金转型前的基金费用按照《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》的相关约定处理。

基金的收益与分配 三、基金收益分配原则

本基金（包括德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止德信 A 份额与德信 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

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、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分

别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的每一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。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

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基金份额持有人自行承担。对于场外份额，当基金份额持有人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该类基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

基金份额折算、德信 A 份额与德信 B 份额的终止运作 第二十部分
基金份额折算

一、基金份额折算日

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年的最后工作日止，如果期间每个工作日德信 B 份额的份额净值都大于 0.400 元，则最后工作日为基金份额折算日；如果期间某个工作日德信 B 份额的份额净值小于或等于 0.400 元，则该日后的第二个工作日为基金份额折算日，具体的基金份额折算日见基金管理人届时发布的公告。

二、基金份额折算类别

根据基金份额折算日的触发条件不同，基金份额折算日分为基金份额到期折算日和基金份额到点折算日，基金份额折算也相应地分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

1、基金份额到期折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年的最后工作日止，如果期间每个工作日德信 B 份额的份额净值都大于 0.400 元，则最后工作日为到期折算日。在到期折算日实施的基金份额折算为基金份额到期折算。

2、基金份额到点折算

自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满两年的最后工作日止，如果期间某个工作日德信 B 份额的份额净值小于或等于 0.400 元，则该日后的第二个工作日为到点折算日。在到点折算日实施的基金份额折算为基金份额到点折算。

三、基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的本基金所有份额。

四、基金份额折算方法

基金份额到期折算和基金份额到点折算的折算方法一致，均按以下方法在基金份额折算日对所有基金份额进行折算：

1、德邦德信基金份额的份额折算

基金份额折算日折算后，德邦德信基金份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。折算后，德邦德信基金份额持有人持有的德邦德信基金份额的份额数按照德邦德信基金份额折算比例相应增加、缩减或不变。若折算前，德邦德信基金份额净值大于 1.000 元，则折算后德邦德信基金份额持有人持有的德邦德信基金份额增加；若折算前，德邦德信基金份额净值小于或等于 1.000 元，则折算后德邦德信基金份额缩减或不变。

德邦德信基金份额的折算比例 = 折算日折算前德邦德信基金份额的基金份额净值 / 1

德邦德信基金份额经折算后的份额数 = 折算日折算前德邦德信基金份额数 × 德邦德信基金份额的折算比例

德邦德信基金份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；德邦德信基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2、德信 A 份额与德信 B 份额的份额折算

基金份额折算日折算后，德信 A 份额与德信 B 份额按照折算前各自

的基金份额净值折算为净值为 1.000 元的德邦德信基金份额的场内份额，具体折算公式如下：

$$\text{德信 A (B) 份额的折算比例} = \frac{\text{折算日折算前德信 A (B) 份额的基金份额净值}}{1}$$
$$\text{德信 A (B) 份额折算为净值为 1.000 元的德邦德信基金份额数量} = \frac{\text{折算前德信 A (B) 份额数量} \times \text{德信 A (B) 份额的折算比例}}{1}$$

德信 A 份额、德信 B 份额折算成的德邦德信基金份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

3、折算后德邦德信基金份额场内份额的分拆

在基金份额折算后，将德邦德信基金份额的场内份额按照 7:3 的比例分拆成德信 A 份额与德信 B 份额。届时，分拆后的德信 A 份额、德信 B 份额与德邦德信基金份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。

五、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停德信 A 份额与德信 B 份额的上市交易和德邦德信基金份额的申购或赎回等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

六、基金份额到期折算和到点折算的公告

1、在到期折算日前三十个工作日（基金合同生效日后不满三十个工作日的情形除外），遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停德邦德信基金份额申购赎回、暂停德信 A 份额与德信 B 份

额上市交易等相关业务，及基金份额到期折算等有关事项，进行提示性公告。

2、如果德信 B 份额的份额净值在某一开放日高于 0.450 元，但在下一开放日不高于 0.450 元的；基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在指定媒体进行提示性公告。

3、如果某个工作日德信 B 份额的份额净值小于或等于 0.400 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。基金管理人将就实施基金份额到点折算的有关事项在指定媒体进行公告。

七、风险提示

基金管理人承诺也不保证德信 A 份额的基金份额持有人获得约定基准收益或不亏损。在本基金出现极端损失的情形下，德信 A 份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定基准收益，也可能遭受本金损失的风险。

第二十一部分 德信 A 份额与德信 B 份额的终止运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，德信 A 份额与德信 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各自表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

二、德信 A 份额与德信 B 份额终止运作后的份额折算

德信 A 份额与德信 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，德信 A 份额与德信 B 份额将全部折算成德邦德信基金份额的场内份额。

1、份额折算基准日

德信 A 份额与德信 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

2、份额折算方式

在折算基准日日终，以德邦德信基金份额的基金份额净值为基准，德信 A 份额与德信 B 份额按照各自的基金份额净值折算成德邦德信基金份额的场内份额。德信 A 份额（或德信 B 份额）基金份额持有人持有的折算后德邦德信基金份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额折算计算公式：

德信 A 份额（或德信 B 份额）的折算比率 = 份额折算基准日德信 A 份额（或德信 B 份额）的基金份额净值 / 份额折算基准日德邦德信基金份额的基金份额净值

德信 A 份额（或德信 B 份额）基金份额持有人持有的折算后德邦德信基金份额的场内份额数 = 基金份额持有人持有的折算前德信 A 份额（或德信 B 份额）的份额数 × 德信 A 份额（或德信 B 份额）的折算比率

3、份额折算后的基金运作

德信 A 份额与德信 B 份额全部折算为德邦德信基金份额的场内份额

后，本基金转型为德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF），本基金接受场外与场内的申购和赎回。

4、份额折算的公告

基金管理人应不迟于德信 A 份额与德信 B 份额终止运作日前 2 日，就分级份额终止运作及份额折算事宜，在指定媒体公告。德信 A 份额与德信 B 份额进行份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

5、基金转型后基金的投资管理

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。 删去。

基金的会计与审计 一、基金会计政策

.....

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； 一、基金会计政策

.....

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

基金的信息披露 二、信息披露义务人

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体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资

者能够按照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。

五、公开披露的基金信息

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，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。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网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；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。

.....

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

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

4、上市交易公告书

德信 A 份额和德信 B 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在德信 A 份额和德信 B 份额上市交易的 3 个工作日前，将相关基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

5、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额的基金份额净值。

在德信 A 份额与德信 B 份额上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理德邦德信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，披露开放日的德邦德信基金份额、德信 A 份额、德信 B 份额各自的基金份额净值和德邦德信基金份额的基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额的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、德邦德信基金份额、德信 A 份额与德信 B 份额各自的基金资产净值、德邦德信基金份额的基金份额累计净值登载在指定媒体上。

6、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德邦德信基金份额申购、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。

.....

11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

.....

16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

.....

21) 德邦德信基金份额开始办理申购、赎回；

22) 德邦德信基金份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；

.....

25) 本基金暂停接受德邦德信基金份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26) 本基金德信 A 份额与德信 B 份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

27) 本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；

28) 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换业务；

29) 本基金实施基金份额折算；

30) 德信 A 份额与德信 B 份额终止运作;

31) 德信 A 份额与德信 B 份额终止运作后德信 A 份额与德信 B 份额的份额转换;

.....

10、基金份额持有人大会决议

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

11、中国证监会规定的其他信息。 二、信息披露义务人

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。

.....

五、公开披露的基金信息

(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。

.....

本基金由德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金转型而来，基金管理人在正式实施转型前将基金招募说明书、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网站上。

2、上市交易公告书

本基金 A 类基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在指定媒介上。

3、基金资产净值公告、各类基金份额的基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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各类基金份额的基金份额净值。

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、基金份额销售机构以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额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各类基金份额的基金份额净值。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、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

4、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销售机构查阅或者复制前述信息资料。

.....

11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

.....

16) 管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17) 基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；

.....

21) 本基金开始办理申购、赎回；

22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

.....

25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26) 本基金 A 类基金份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；

27) 本基金推出新业务或服务;

28) 本基金调整基金份额类别设置;

.....

8、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。

9、投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

10、投资中小企业私募债信息披露

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应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，并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

.....

八、暂停或延迟披露基金信息的情形

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信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停或延迟估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，自决议生效之日起依照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

.....

三、基金财产的清算

(7) 对基金财产进行分配。 一、基金合同的变更

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效且方可执行，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

.....

三、基金财产的清算

(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。

违约责任 1、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规、市场交易规则作为或不作为而造成的损失等；

2、基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

3、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，由于该机构欺诈、疏忽、过失或破产等原因给本基金资产造成的损失等；

四、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。 1、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

2、基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行投资或不投资所造成的损失等；

四、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

争议的处理和适用的法律 各方当事人同意，凡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，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

各方当事人同意，凡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，均应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

基金合同的效力 基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

一、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

.....

四、基金合同正本一式八份，除上报中国证监会和银行业监督管理机构各一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。 基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务

关系的法律文件。

一、基金合同由《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》修订而来，经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并经 XX 年 XX 月 XX 日德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，自基金转型实施起生效，《德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金基金合同》同一日起失效。

.....

四、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。