

华泰紫金天天金交易型货币市场基金 上市交易公告书

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2017年8月28日

公告日期：2017年8月23日

目录

一、	重要声明与提示	3
二、	基金概览	3
三、	基金的募集与上市交易	4
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	6
五、	基金主要当事人简介	7
六、	基金合同摘要	9
七、	基金财务状况	9
八、	基金投资组合	10
九、	重大事件揭示	11
十、	基金管理人承诺	11
十一、	基金托管人承诺	11
十二、	备查文件目录	12
附件：	基金合同摘要	13

一、 重要声明与提示

《华泰紫金天天金交易型货币市场基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,华泰紫金天天金交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读2017年7月20日刊登在《中国证券报》等报刊及华泰证券(上海)资产管理有限公司网站(htamc.htsc.com.cn)上的《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》。

二、 基金概览

- 1、基金名称:华泰紫金天天金交易型货币市场基金
- 2、份额类别:本基金设两类基金份额,A类为场内基金份额,B类为场外基金份额。
- 3、基金二级市场交易简称:华泰天金
- 4、二级市场交易代码: 511670
- 5、基金场内申购、赎回简称:华泰天金
- 6、场内申购、赎回代码: 511671
- 7、截至公告日前两个工作日即2017年8月21日基金份额总额:A类基金份额74,310,340份; B类基金份额7,804,721,221.03份
- 8、截至公告日前两个工作日即2017年8月21日基金份额净值: A类100元; B类1元
- 9、本次上市交易份额(A类基金份额): 74,310,340份
- 10、上市交易的证券交易所: 上海证券交易所
- 11、上市交易日期: 2017年8月28日
- 12、基金管理人: 华泰证券(上海)资产管理有限公司
- 13、基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
- 14、上市推荐人: 无
- 15、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”): 华泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司

三、 基金的募集与上市交易

(一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2017 年 5 月 16 日证监许可[2017]710 号文准予注册。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金募集期自 2017 年 7 月 25 日至 2017 年 8 月 7 日，通过场外认购和场内认购两种方式公开发售。场外认购的发售日期为 2017 年 7 月 25 日至 2017 年 8 月 7 日；场内网上现金认购的发售日期为 2017 年 8 月 3 日至 2017 年 8 月 7 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网上现金认购 3 个工作日。

7、发售方式：A 类为场内基金份额，通过场内认购方式发售；B 类为场外基金份额，通过场外认购方式发售。其中，场内认购是网上现金认购。

8、发售机构：

场外认购：

(1) 直销机构

华泰证券（上海）资产管理有限公司

(2) 代销机构

华泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、上海汇付金融服务有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司

场内认购：

(1) 发售主协调人

华泰证券股份有限公司

(2) 网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售代理机构为具有基金销售业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司。具体名单可以在上海证券交易所网站查询。

(二) 基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2017]710 号文号文批准，自 2017 年 7 月 25 日起公开募集，截止 2017 年 8 月 7 日，基金募集工作已顺利结束。经毕马威华振会计师事务所验资，本次募集的募集金额总额为 15,229,617,858.38 元人民币，折合基金份额 15,229,617,858.38 份；经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计 984,336.69 元人民币，折合基金份额 984,336.69 份，归基金份额持有人所有；网上现

金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息共计 1,353,115.49 元，归入基金财产。募集资金已于 2017 年 8 月 11 日划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 9,836 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计 15,230,602,195.07 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中募集期间基金管理人运用自有资金认购本基金 100,009,000.00 份，占基金总份额 0.66%。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

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》以及《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2017 年 8 月 11 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金份额折算

根据《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》和《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金在基金合同生效当日，华泰证券（上海）资产管理有限公司为本基金A类基金份额办理份额折算，并由登记机构进行A类基金份额的变更登记。A类基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后基金份额持有人所持有的基金份额的净值占基金资产净值的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

本基金基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。本次募集 A 类基金份额的认购金额为 7,431,034,000.00 元，折算前 A 类基金份额总额为 7,431,034,000.00 份，折算前基金份额净值为 1.00 元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法，本基金折算后的 A 类基金份额总额为 74,310,340 份，折算后基金份额净值为 100 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对A类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2017年8月11日进行了变更登记。

（四）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2017]279号

2、上市交易日期：2017年8月28日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场交易简称：华泰天金

5、二级市场交易代码：511670

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易

6、基金申购、赎回简称：华泰天金

7、申购、赎回代码：511671

本基金管理人自 2017年8月28日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金A类基金份额的申购和赎回。

目前本基金A类基金份额的一级交易商包括：华泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司

上述排名不分先后。本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告。

8、本次上市交易份额（A类基金份额）：74,310,340份

9、未上市交易份额的流通规定：本基金A类基金份额上市交易后，所有的A类基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的为A类基金份额。本基金B类基金份额为场外份额，不上市交易。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）场内持有人户数

截至 2017 年 8 月 21 日，本基金场内份额持有人户数为 6,919 户，平均每户持有的基金份额为 10,740.04 份。

（二）场内持有人结构

截至 2017 年 8 月 21 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 50,726,980 份，占基金场内总份额的 68.26%；个人投资者持有的场内基金份额为 23,583,360 份，占基金场内总份额的 31.74%。

（三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2017 年 8 月 21 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金场内总份额的比例（%）
1	华泰证券股份有限公司	15,000,000.00	20.19
2	南方资本—广发银行—广钜2号资产管理计划	13,547,130.00	18.23
3	陈卫	1,000,010.00	1.35
4	天津天保财务有限公司	1,000,000.00	1.35
5	云南国际信托有限公司—云南信托云霞9期集合资金信托计划	1,000,000.00	1.35
6	华泰证券资管—广发银行—华泰紫金瑞盈1号分级债券集合资产管理计划	1,000,000.00	1.35
7	中银国际证券有限责任公司	1,000,000.00	1.35

8	华泰证券资管—南京银行—华泰远见6号集合资产管理计划	930,000.00	1.25
9	江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	700,000.00	0.94
10	华泰期货有限公司—华泰期货理邦华泰一号资产管理计划	500,080.00	0.67

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司
- 2、法定代表人：崔春
- 3、注册资本：26亿元人民币
- 4、住所及办公地址：中国（上海）自由贸易试验区东方路18号21层
- 5、设立批准文号：中国证监会证监基字〔2014〕679号
- 6、统一社会信用代码：91310000312590222J
- 7、经营范围：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理及中国证监会批准的其他业务
- 8、股权结构：一人有限责任公司（法人独资）
- 9、组织结构

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东有权决定公司的经营方针和投资计划，以及委派和更换董事、监事等事宜。公司董事会由3名董事组成，根据公司章程的规定，董事会行使向股东报告工作，执行股东的决定，决定公司的经营计划和投资方案等职责。公司设监事1名，对公司的经营行使监督权。

10、人员情况

截至2017年6月底，我公司共有员工180人，博士9人、硕士149人、本科22人、其他0人。

11、信息披露负责人：朱鸣

咨询电话：021-28972112

12、本基金基金经理简介

韩克先生，金融学硕士，曾任南方基金管理有限公司交易管理部债券交易员，固定收益部研究员。2015年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司从事固定收益产品投资研究工作。

（二）基金托管人

1、基金托管人概况

名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系电话：(010)6759 5096

联系人：田青

2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

（三）上市推荐人

无

(四) 一级交易商

(1) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路228号

法定代表人：周易

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

(2) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

客服电话：95587

公司网站：www.csc108.com

(3) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街5号

办公地址：苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

客服电话：95330

公司网站：<http://www.dwjq.com.cn/>

(五) 验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

执行事务合伙人：王国蓓

联系电话：（010）85085000

传真电话：（010）85185111

经办注册会计师：王国蓓、张楠

联系人：张楠

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用, 不从基金资

产中支付。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

本基金 2017 年 8 月 21 日资产负债表如下：

资 产	期末余额	年初余 额	负债和所有者权 益	期末余额	年初余 额
资 产：			负债：		
银行存款	15,225,952,945.56		短期借款		
结算备付金			交易性金融负债		
存出保证金			衍生金融负债		
交易性金融资产			卖出回购金融资 产款		
其中：股票投资			应付证券清算款		
债券			应付赎回款		
投资			应付管理人报酬	834,813.27	
资产			应付托管费	375,665.99	
支持证券投资			应付销售服务费	1,043,516.60	
基金			应付交易费用		
投资			应付税费		
衍生金融资产			应付利息		
买入返售金融资产	6,000,000.00		应付利润	1,293,867.43	
应收证券清算款			其他负债	9,999.99	
应收利息	13,623,647.36		负债合计	3,557,863.28	
应收股利			所有者权益：		
应收申购款			实收基金	15,242,018,729.64	
其他资产			未分配利润		
			所有者权益合计	15,242,018,729.64	
资产合计：	15,245,576,592.92		负债与持有人权 益总计：	15,245,576,592.92	

八、 基金投资组合

截止到 2017 年 8 月 21 日，本基金的投资组合如下：

资产类别	市 值（元）	占总资产的比例（%）
------	--------	------------

1	股票		
2	基金		
3	债券		
4	其中：央票		
5	国债		
6	政策性金融债		
7	金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券）		
8	企业债		
9	企业短期融资券		
10	可转债		
11	权证		
12	资产支持证券		
13	货币市场工具（票据、CD）		
14	现金（银行存款及清算备付金）	5,952,945.56	0.04
15	银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）	15,220,000,000.00	99.83
16	其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等）	19,623,647.36	0.13
17	其中：买入返售证券	6,000,000.00	0.04
18	资产合计	15,245,576,592.92	100

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉

尽责的原则安全保管基金资产。

(二) 根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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

十二、 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予本基金注册的文件；
- (二) 《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》
- (三) 《华泰紫金天天金交易型货币市场基金托管协议》
- (四) 《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照

风险提示：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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇一七年八月二十三日

附件：基金合同摘要

一、 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

1. 基金管理人的权利与义务

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；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法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、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用，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；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (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) 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；
- (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认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- (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。

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；
- (2) 办理基金备案手续；

- (3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
- (7) 依法接受基金托管人的监督;
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,各类基金份额的每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益和七日年化收益率;
- (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,法律法规另有规定的从其规定;
- (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内发出,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) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2. 基金托管人的权利与义务

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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(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。

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、各类基金份额的每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益和七日年化收益率;
- (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) 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;
- (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定;
- (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。

3. 基金份额持有人的权利与义务

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》取得的基金份额,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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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) 按照规定要求召开或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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- (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定;
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
- (9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则;
- (10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息,以及不时的更新和补充,并保证其真实性;
- (11) 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

1. 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 1 份 A 类基金份额与每 100 份 B 类基金份额具有同等的投票权;同一类别内的每一基金份额拥有平等的投票权。

为体现基金份额持有人的权益,本基金合同第十部分及基金合同其他条款中涉及基金份额持有人的提议召集权、召集权、计算到会或出具表决意见的持有人所代表的基金份额数量、表决权等需要统计基金份额持有人所持份额及其占总份额比例时,每一份 A 类基金份额均与每 100 份 B 类基金份额代表同等权利。

2. 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或基金合同另有约定的除外):

- 1) 终止基金合同;
- 2) 转换基金运作方式;
- 3) 变更基金类别;
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- 5) 变更基金份额持有人大会程序;
- 6) 更换基金管理人、基金托管人;
- 7) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- 8) 提高销售服务费计提标准;
- 9) 本基金与其他基金的合并;
- 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 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;

12) 终止 A 类基金份额上市,但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外;

- 13) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- 14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低销售服务费;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改;

4) 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本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;

5) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

6) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金推出新业务或服务;

7) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,增加或减少份额类别,或调整基金份额分类办法及规则;

8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集，并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。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（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。

(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要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）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。

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

4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 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；
- 6) 代理投票的授权证明的内容要求(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；

- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和表决方式, 并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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, 不影响计票和表决结果。

5. 基金份额持有人出席会议的方式

(1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。会议的召开方式由会议召集人确定。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

3) 通讯方式开会。系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人确定的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人确定的非现场方式进行表决。

4) 在法律法规或监管机构允许的情况下, 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, 或者采用网络、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列明。

5) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的, 授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式, 具体方式在会议通知中列明。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

一是现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%, 下同); 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 50%(含 50%), 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) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

二是通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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 50%(含 50%)，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；

5) 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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记机构记录相符。

6. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）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进行解释和说明。

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) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）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。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

(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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

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

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

2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一份 A 类基金份额具有一票表决权，所持每 100 份 B 类基金份额具有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上（含

50%) 通过方为有效, 除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人) 所持表决权的三分之二以上(含三分之二) 通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同(本基金合同另有约定的除外)、与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

(3) 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。

(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, 否则表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决, 表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决, 但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

(7) 在上述规则的前提下, 具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

8. 计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集, 则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推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, 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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人; 但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席, 则大会主持人可自行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, 由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议, 可以对投票数进行重新清点; 如大会主持人未进行重新清点, 而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议, 其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点, 大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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; 如监督人经通知但拒绝到场监督, 则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票, 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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

9. 生效与公告

(1) 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。

(2) 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。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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介公告。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。

10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

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

1. 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- (1) 本基金的同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(4) 本基金 A 类基金份额采用“每日分配、利随本清”的原则。根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。收益账户高于 100 元以上的整百元收益于每个工作日转为基金份额支付到投资人的证券账户。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

投资人赎回 A 类基金份额时，其对应比例的累计未付收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计未付收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人卖出部分 A 类基金份额时，不支付对应的累计未付收益；但投资人全部卖出 A 类基金份额时，以现金方式将全部累计未付收益与投资人结清；

- (5) 本基金 B 类基金份额采用“每日分配、每日支付”的原则。根据每日基金收益情

况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付，支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；投资人可通过赎回 B 类基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；其当日净收益为负值，则缩减投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；

投资人赎回部分 B 类基金份额时，不支付对应的未结转份额，且剩余的基金份额需足以弥补其当前未结转份额为负值时的损益；但投资人赎回全部场外基金份额时，则对应收益将立即结清；

（6）当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额及其对应的收益自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；

（7）投资人当日买入的基金份额自买入当日起，享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

（8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2. 收益分配方案

本基金按日计算并分配收益，基金管理人另行公告基金收益分配方案。

3. 收益分配的公告和实施

本基金每工作日进行收益分配。

每开放日公告前一个开放日 A 类基金份额的每百份基金已实现收益、B 类基金份额的每万份基金已实现收益及两类基金份额的七日年化收益率。

若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的 A 类基金份额的每百份基金已实现收益、B 类基金份额的每万份基金已实现收益和节假日最后一日两类基金份额的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日的 A 类基金份额的每百份基金已实现收益、B 类基金份额的每万份基金已实现收益和两类基金份额的七日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金每日例行的收益分配不再另行公告。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1. 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）销售服务费；
- （4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）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；
- （6）基金份额持有人大会费用；

- (7) 基金的证券交易费用;
- (8) 基金上市费及年费 (仅 A 类基金份额承担);
- (9) 基金的银行汇划费用;
- (10) 证券账户开户费用、银行账户维护费用;
- (11) 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。

2. 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

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下:

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在次月前 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需再出具资金划拨指令, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.09% 年费率计提。计算方法如下:

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在次月前 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需再出具资金划拨指令, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

(3) 基金销售服务费

本基金的销售服务费年费率为 0.25%, 销售服务费计提的计算公式如下:

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在次月前 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需再出具资金划拨指令, 若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延至最近可支付日支付。费用扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

(4) 除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

3. 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) 基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费等相关费用；
- (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。

4. 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定的程序调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

其中，基金管理人与基金托管人协商一致调低基金销售服务费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

5. 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、 基金财产的投资方向和投资限制

1. 投资目标

在保持本金的安全性和基金财产的流动性的前提下，追求高于比较基准的稳定收益。

2. 投资范围

本基金的投资范围包括：

- (1) 现金；
- (2) 期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；
- (3) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；
- (4) 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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

3. 投资策略

本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。

本基金对固定收益类证券的投资，综合采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，对

固定收益类证券进行科学合理的配置。自上而下部分主要是根据宏观经济发展状况、货币政策等的分析对市场利率进行动态预测，以此为基础对债券的类属和期限等进行配置；自下而上部分主要从到期收益率、流动性、信用风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析，对优质债券进行重点配置。

（1）利率预期策略

利率预期策略旨在对市场利率进行动态预测，并以此为基础进行债券类属配置并调整债券组合久期。本基金根据宏观经济发展状况、货币政策以及债券市场供需状况等来预测利率走势，主要考虑：GDP 增长率、通货膨胀率、固定资产投资增长率、出口状况、居民消费、货币供应增长率、新债发行量等因素。

（2）债券选择策略

对单个债券将分别从流动性、债券条款、久期、凸性等因素进行价值分析。根据对债券组合久期的安排，结合单只债券流动性与信用风险特征，对单只债券的久期进行选择。其它特征相似时，选取凸性较大的债券，这是因为其它因素相同时，凸性较大的债券在利率上升时贬值较少，而在利率下降时增值较大。

（3）资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

4. 投资限制

（1）本基金不得投资于以下金融工具：

- 1) 股票；
- 2) 可转换债券、可交换债券；
- 3) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；
- 4) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；
- 5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制，基金管理人履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

（2）组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期限不得超过 240 天；
- 2) 投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产

支持证券的比例占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；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%；

3) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受此限制；

4) 本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%；投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计，不得超过 5%；

5) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

6) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；

7) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；

8) 除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 20%；

9) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

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%；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%；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%；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%；

11) 本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)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；

12) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

13) 中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级，如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的，应采用孰低原则确定其评级，并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定。

除上述第 1)、5)、11) 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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律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上述限制。

（3）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。

（4）关联交易

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。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。

5. 投资组合平均剩余期限和剩余存续期限计算方法

（1）计算公式

平均剩余期限（天）的计算公式如下：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

平均剩余存续期限（天）的计算公式如下：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、一年以内(含一年)的银行定期存款、同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、期限在一年以内(含一年)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

(2) 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定方法

1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交割日的剩余交易日天数计算；

2) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

3) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

4) 中央银行票据、资产支持证券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据、资产支持证券到期日的实际剩余天数计算；

5) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算；

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

6) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。

平均剩余期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。

6. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

7. 风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

8. 基金管理人代表基金行使证券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证券权利，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。

六、 基金资产净值的计算方法和公告方式

1. 估值方法

本基金按以下方式进行估值：

(1) 本基金估值采用“摊余成本法”估值，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

(2) 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内；当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

(3) 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方法估值。

(4) 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。

根据法律法规，基金管理人计算并公告基金资产净值、各类基金份额的每百份或每万份基金已实现收益及七日年化收益率，基金托管人复核、审查。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，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金资产净值、各类基金份额的每百份或每万份基金已实现收益及七日年化收益率的计算结果对外予以公布。

2. 估值程序

本基金 A 类基金份额每百份基金已实现收益指按照相关法规计算的每百份基金份额的日净收益，B 类基金份额每万份基金已实现收益指按照相关法规计算的每万份基金份额的日净收益，每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益精确到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。七日年化收益率是以最近七个自然日(含节假日)收益所折算的年收益率，精确到 0.001%，百分号内小数点后第 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，将基金资产净值、每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益和七日年化收益率发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3. 暂停估值的情形

- (1) 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；
- (2) 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- (3) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

4. 基金净值的确认

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值与面值保持一致。该基金份额净值是计算基金申购与赎回价格的基础。

用于基金信息披露的基金资产净值、每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益和七日年化收益率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、每百份基金已实现收益、每万份基金已实现收益和七日年化收益率并发送给基金托管人。基金托管人复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人根据基金合同约定予以公布。

七、 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1. 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后生效方可执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。

2. 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- (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) 中国证监会规定的其他情况。

3. 基金财产的清算

(1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止的，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

(2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 9) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 10) 公布基金财产清算结果；
- 11) 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

(3) 清算费用

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

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；

4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配，基金份额持有人持有的每 1 份 A 类基金份额与每 100 份 B 类基金份额拥有同等的分配权。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5. 基金财产清算的公告

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组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 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

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本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

本基金合同正本一式六份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持一份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构办公场所查阅。