鹏华丰信分级债券型证券投资基金

更新的招募说明书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司基金托管人：上海银行股份有限公司

2017 年 12 月

重要提示

鹏华丰信分级债券型证券投资基金（以下简称本基金）经 2013 年 7 月 18 日中国证券监督管理委员会《关于核准鹏华丰信分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可

[2013]938 号文）核准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2013 年 10 月 22 日正式生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

自基金合同生效之日起，丰信 A 自基金合同生效日起每半年开放一次，于丰信 A 的申购开放日接受申购，于丰信 A 的赎回开放日接受赎回，丰信 B 自基金合同生效日起每年开放一次接受投资者的申购或赎回。

总体来看，本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，丰信 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额，但基金管理人并不承诺或保证丰信 A 的约定收益，在极端情形下，比如基金资产在短期内发生大幅度的投资亏损时，丰信 A 的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。丰信 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险及其他风险，等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品予以投资。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 10 月

21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（未经审计）。

目 录

一、 绪 言

二、 释 义

三、 基金管理人

四、 基金托管人

五、 相关服务机构

六、 基金份额的分级

七、 基金的募集与基金合同的生效

八、 基金份额的申购与赎回

九、 基金的投资

十、 基金的业绩

十一、 基金的财产

十二、 基金资产的估值

十三、 基金的收益分配

十四、 基金的费用与税收

十五、 基金的会计与审计

十六、 基金的信息披露

十七、 风险揭示

十八、 基金的终止与清算

十九、 基金合同的内容摘要

二十、 基金托管协议的内容摘要

二十一、对基金份额持有人的服务

二十二、其他应披露事项

二十三、招募说明书的存放及查阅方式二十四、备查文件

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）等有关法律法规的规定，以及《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了鹏华丰信分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有以下含义：

1、 基金或本基金：指鹏华丰信分级债券型证券投资基金

2、 基金管理人：指鹏华基金管理有限公司

3、 基金托管人：指上海银行股份有限公司

4、 基金合同或本基金合同：指《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华丰信分级债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、 招募说明书：指《鹏华丰信分级债券型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《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》

8、 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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

10、 《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

11、 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的

《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、 《运作办法》：指中国证监会 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

13、 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15、 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

20、 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、 基金份额分级：指自基金合同生效之日起，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即丰信 A 份额和丰信 B 份额，两级份额的配比原则上不超过 7：3

22、 丰信 A：指鹏华丰信分级债券型证券投资基金的丰信 A 份额

23、 丰信 B：指鹏华丰信分级债券型证券投资基金的丰信 B 份额 24、丰信 A 的申购开放日：自基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日为丰信 A 的申购开放日。申购开放日只可提交丰信 A 的申购申请

25、 丰信 A 的赎回开放日：自基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日（即丰信 A 的申购开放日）的前一工作日为丰信 A 的赎回开放日。赎回开放日只可提交丰信 A 的赎回申请

26、 丰信 A 的基金份额折算：自基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日，丰信 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，其基金份额数按折算比例相应增加或减少的行为

27、 丰信 B 的申购赎回开放日：丰信 B 自基金合同生效之日起每年开放一次，每次开放一个工作日。自基金合同生效之日起每满一年的最后一个工作日的前一工作日为丰信 B 的申购赎回开放日，供投资者提交申购赎回申请

28、 丰信 B 的基金份额折算：自基金合同生效之日起每满一年的最后一个工作日，丰信 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，其基金份额数按折算比例相应增加或减少的行为

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

30、 销售机构：指鹏华基金公司以及符合《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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

31、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

32、 登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为鹏华基金管理有限公司或接受鹏华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

35、 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

36、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期 37、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

38、 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、 T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

41、 T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

42、 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、 开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、 《业务规则》：指《鹏华基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

45、 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

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

47、 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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

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

50、 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

51、 巨额赎回：基金合同生效之日起丰信 A 或丰信 B 开放时，依本合同约定的申购与赎回申请的确认原则进行申购与赎回申请的成交确认后，丰信 A 的净赎回份额（赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额）与丰信 B 的净赎回份额（赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额，如有）的总和超过本基金前一日基金总份额的 10%时的情形

52、 元：指人民币元 53、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

54、 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

55、 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

56、 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

57、 虚拟清算：即假定 T 日为本基金的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值

58、 基金份额参考净值：在 T 日基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

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

60、 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

61、 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

1、名称：鹏华基金管理有限公司

2、住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

3、设立日期：1998 年 12 月 22 日

4、法定代表人：何如

5、办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

6、电话：（0755）82021233　　传真：（0755）82021155

7、联系人：吕奇志

8、注册资本：人民币 1.5 亿元

9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 计	15,000	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁，国信证券股份有限公司副总裁，国信证券股份有限公司公司顾问。

Massimo Mazzini 先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司

（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）市场及业务发展总监。

Andrea Vismara 先生，董事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A）董事会秘书兼任企业事务部总经理，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000 年 7 月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015 年 6 月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005 年 6 月至 2007 年 12 月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007 年 12 月至 2010 年 12 月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007 年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI 先生，监事，工商管理学士，国籍：意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗 IMI 资产管理 SGR 企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理和投资经理，现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务负责人。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师；2011 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务主管，现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生，职工监事，大专学历，国籍：中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监；2011 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任登记结算部总经理。

刘嵚先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任毕马威（中国）管理顾问公司咨询顾问，南方基金管理有限公司北京分公司副总经理；2014 年 10 月加入鹏华基金管理有限公司，现任首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，总裁，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总

支书记。高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国

际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法学硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投资部处长、股权资产部（实业投资部）副主任，并于 2014 年至 2015 年期间担任中国证监会第 16 届主板发审委专职委员，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、电子商务部总经理。

苏波先生，副总裁，管理学博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理，鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部，中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

韩亚庆先生，副总经理，经济学硕士。国籍：中国。历任国家开发银行资金局主任科员，全国社保基金理事会投资部副调研员，南方基金管理有限公司固定收益部基金经理、固定收益部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4、本基金基金经理

戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，15 年证券基金从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职。2011 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券

（LOF）基金基金经理，2012 年 06 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企债基金基金经理，2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013 年 10 月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理，2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理。戴钢先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况：

2011 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理

2012 年 06 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理

2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企债基金基金经理

2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理

2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理

2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理

2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理

2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理

2016 年 08 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理本基金历任的基金经理：

2013 年 10 月至本更新招募书截止日　　戴钢先生

5、投资决策委员会成员情况邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。邢彪先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

梁浩先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合基金经理。

赵强先生，鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部 FOF 投资副总监。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2.办理基金备案手续；

3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6.编制中期和年度基金报告；

7.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；

8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9.召集基金份额持有人大会；

10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

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

2.基金管理人的禁止行为：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3.基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反法律法规、基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6） 玩忽职守、滥用职权；

（7） 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8） 除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

（9） 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（10） 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（11） 贬损同行，以提高自己；

（12） 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13） 以不正当手段谋求业务发展；

（14） 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（15） 其他法律、行政法规禁止的行为。

4.基金经理承诺

（1） 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2） 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3） 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4） 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1.内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

（1） 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2） 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3） 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

（4） 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；（5）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2.制订内部控制制度应当遵循以下原则：

（1） 合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

（2） 全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

（3） 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

（4） 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

3.内部控制体系

（1） 董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

（2） 公司督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告。

（3） 公司经营管理层、督察长、监察稽核部、公司各部门总经理定期召开会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施。

（4） 监察稽核部负责对基金管理人各部门的风险控制情况进行检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出整改建议。

（5） 业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务。

（6） 员工：依照公司“全面风险管理、全员风险控制”的理念，公司每个员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险控制理念和措施落实到每一个业务环节当中，并负有把业务过程中发现的风险隐患或风险问题及时进行报告、反馈的义务。

4.内部控制措施

（1）公司通过不断健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，力争从源头上杜绝不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司合法权益。（2）管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工的风险防范意

识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

（3） 公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控防线。

（4） 建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，公司不断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不断走向完善。

（5） 建立健全各项管理制度和业务规章：公司建立了包括投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

（6） 建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

（7） 建立健全了岗位责任制：公司通过健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

（8） 构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过明晰的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层即时把握风险状况并及时、快速作出风险控制决策。

（9） 建立自动化监督控制系统：公司启用了恒生交易系统以及自行开发的投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制、“禁止买入股票名单”、交叉交易等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风险。

（10） 不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓位等由投资决策委员会决定。

同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

5.基金管理人关于内部合规控制书的声明（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2） 本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3） 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

四、基金托管人

1、基本情况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号法定代表人：金煜

成立时间：1995 年 12 月 29 日

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）注册资本：

人民币 78.05785 亿元存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会 证监许可[2009]814 号

托管部门联系人：闻怡电话：021－68475888 传真：021－

68476936

上海银行成立于 1995 年 12 月 29 日，是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行，总行位于上海，是上海证券交易所主板上市公司，股票代码 601229。

近年来，上海银行以“精品银行”为战略愿景，以“精诚至上，信义立行”为企业核心价值观，以“总体形成特色、区域兼顾差异、局部凸显亮点”为指导思想，持续推进专业化经营和精细化管理，经营实力和发展能力明显提升。根据市场和自身优势，上海银行形成了“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理和养老金融服务”、“金融市场领先交易服务”、“两岸三地跨境金融服务”以及“最佳在线金融服务”等特色定位，通过培育和塑造经营特色，推动结构调整和转型发展，增强可持续发展能力。

目前，上海银行在上海、宁波、南京、杭州、天津、成都、深圳、北京、苏州、无锡、绍兴、南通、盐城等地拥有分支机构和营业网点 311 个，设有自助银行 211 个，布放自助服务类终端设备 2167 台，初步形成了覆盖长三角、环渤海、珠三角、中西部重点城市的网络布局框架。上海银行还发起设立闵行上银、衢江上银、江苏江宁上银和崇州上银村镇银行，发起成立上银基金管理有限公司，在香港地区设立上海银行（香港）有限公司，并与全球 130 多个国家和地区近 1600 多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

成立 20 年来，上海银行市场竞争力和影响力不断提高，在英国《银行家》2017 年公布的“全球前 1000 家银行”排名中，按一级资本和总资产计算，上海银行分别位列全球

银行业第 85 位和 89 位；多次被《亚洲银行家》杂志评为“中国最佳城市零售银行”，先后荣获“上海市著名商标”、“全国银行间市场优秀交易成员”、“最佳企业形象奖”、“中国银行业发展论坛-最佳城市商业银行”、“上海清算所 2015 年度优秀清算会员”、“债券净额清算优秀奖”、“2015 年度上海市金融创新二等奖”、“2015 年度银行间本币市场交易 200 强”等荣誉称号，并当选第二届中国银行业协会城商行工作委员会主任单位。

截至 2016 年底，上海银行资产总额 17,553.71 亿元,较期初增长 21.13%；客户存款余额为 8,490.73 亿元，较期初增长 7.11%；客户贷款和垫款总额为 5,540 亿元，较期初增长 3.26%；资本充足率为 13.17%；拨备覆盖率 255.50%。

2、主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设产品管理部、托管运作部（下设托管运作团队和运行保障团队）、稽核监督部，平均年龄 30 岁左右，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

3、基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号。

截至 2017 年 9 月 30 日，上海银行已托管 28 只证券投资基金，分别为天治成长精选混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续发展 100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、鹏华兴益定期开放灵活配置混合型基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、博时富海纯债债券型证券投资基金以及博时盈海纯债债券型证券投资基金，托管基金的资产净值合计 418.21 亿元。

基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和本行有关规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。 3、内部控制的原则

（1） 全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。

（2） 独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3） 相互制约原则：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4） 审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提，保证托管资产的安全与完整；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

（5） 有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

4、内部控制制度及措施

（1） 建立明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2） 建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。

（3） 专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4） 托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。

（5） 定期开展业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6） 制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中断。

基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有违反法律法规和基金合同的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

五、相关服务机构

（一） 基金份额销售机构

1、直销机构

（1）鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

电话：（0755）82021233 传真：（0755）82021155 联系人：吕奇志

（2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号 502 室

电话：（010）88082426 传真：（010）88082018

联系人：张圆圆

（3）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗银行大厦 801B 室

电话：（021）68876878 传真：（021）68876821 联系人：李化怡

（4）鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 I 座 1001 室联系电话：（027）85557881

传真：（027）85557973 联系人：祁明兵

（5）鹏华基金管理有限公司广州分公司办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元联系电话：（020）38927993

传真：（020）38927990 联系人：周樱

2、其他销售机构

（1）银行销售机构

1） 东莞农村商业银行股份有限公司注册地址：广东省东莞市城区南城路 2 号办公地址：广东省东莞市城区南城路 2 号法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

客户服务电话：961122 网址：www.drcbank.com

2） 福建海峡银行股份有限公司注册地址：福建省福州市晋安区六一北路 158 号办公地址：福建省福州市晋安区六一北路 158 号法定代表人：苏素华

联系人：黄钰雯

客户服务电话：400-893-9999 网址：www.fjhxbank.com

3） 广东顺德农村商业银行股份有限公司注册地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号办公地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号法定代表人：姚真勇

客户服务电话：0757-22223388

网址：www.sdebank.com

4） 杭州银行股份有限公司注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦法定代表人：吴太普

联系人：严峻

客户服务电话：95398

网址：www.hzbank.com.cn

5） 徽商银行股份有限公司注册地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

客户服务电话：4008896588 网址：www.hsbank.com.cn

6） 江苏江南农村商业银行股份有限公司注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号法定代表人：陆向阳

联系人：蒋娇

客户服务电话：0519-96005 网址：www.jnbank.com.cn

7） 江苏张家港农村商业银行股份有限公司注册地址：江苏省张家港市人民中路66号办公地址：江苏省张家港市人民中路66号法定代表人：季颖

联系人：朱芳

客户服务电话：0512-96065 网址：www.zrcbank.com

8） 交通银行股份有限公司注册地址：上海市浦东新区银城中路188号办公地址：上海市浦东新区银城中路188号法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

9） 平安银行股份有限公司注册地址：深圳市深南东路5047号办公地址：深圳市深南东路5047号法定代表人：谢永林

联系人：张莉

客户服务电话：95511-3 网址：bank.pingan.com

10） 上海银行股份有限公司注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号法定代表人：金煜联系人：汤征程

客户服务电话：95594

网址：www.bankofshanghai.com

11） 兴业银行股份有限公司注册地址：福州市湖东路154号中山大厦办公地址：上海市江宁路168号法定代表人：高建平

联系人：刘玲

客户服务电话：95561 网址：www.cib.com.cn

12） 招商银行股份有限公司注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

13） 中国工商银行股份有限公司注册地址：北京复兴门内大街 55 号办公地址：北京复兴门内大街 55 号法定代表人：易会满

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

14） 中国建设银行股份有限公司注册地址：北京市西城区金融大街 25 号办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼法定代表人：田国立

联系人：王未雨

客户服务电话：95533 网址：www.ccb.com

15） 中国民生银行股份有限公司注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

16） 中国邮政储蓄银行股份有限公司注册地址：北京市西城区金融大街 3 号办公地址：北京市西城区金融大街 3 号法定代表人：李国华

联系人：王硕

客户服务电话：95580 网址：www.psbc.com

17） 珠海华润银行股份有限公司注册地址：中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号办公地址：中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号法定代表人：刘晓勇

联系人：李阳

客户服务电话：400-880-0338或96588（广东省外请加拨0756）网址：www.crbank.com.cn

（2）证券公司销售机构

1）大同证券有限责任公司注册地址：山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心12层法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务电话：4007-121212

网址：www.dtsbc.com.cn

2）第一创业证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

3）华融证券股份有限公司注册地址：北京市西城区金融大街8号办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

客户服务电话：95390

网址：www.hrsec.com.cn

4）华西证券股份有限公司注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

5）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b)单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

客户服务电话：95323/4001099918（全国）/021－32109999/029-68918888 网址：www.cfsc.com.cn

6）开源证券股份有限公司注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

客户服务电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

7）民生证券股份有限公司注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

客户服务电话：95376 网址：www.mszq.com

8）平安证券股份有限公司注册地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层办公地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

9）申万宏源证券有限公司注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

客户服务电话：95523/4008895523

网址：www.swhysc.com

10） 天风证券股份有限公司注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼法定代表人：余磊

联系人：夏旻

客户服务电话：95391/4008005000 网址：www.tfzq.com

11） 西部证券股份有限公司注册地址：西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦办公地址：西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

12） 西南证券股份有限公司注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号法定代表人：吴坚

联系人：张煜

客户服务电话：4008096096、95355 网址：swsc.com.cn

13）中国国际金融股份有限公司注册地址：北京市朝阳

区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层办公地

址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层

及 28 层法定代表人：毕明建（代）

联系人：杨涵宇

客户服务电话：4009101166 网址：www.cicc.com.cn

（3）期货公司销售机构

1）中信建投期货有限公司

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼法定代表人：彭文德

联系人：刘芸

客户服务电话：400-8877-780

网址：www.cfc108.com

（4）第三方销售机构

1） 北京蛋卷基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客户服务电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

2） 北京恒天明泽基金销售有限公司注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室办公地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室法定代表人：黄永伟

联系人：侯仁凤

客户服务电话：400-786-8868 网址：www.chtfund.com

3） 北京虹点基金销售有限公司办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层法定代表人：胡伟

4） 北京汇成基金销售有限公司注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

客户服务电话：010-56282140 网址：www.hcjijin.com

5） 北京增财基金销售有限公司注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室法定代表人：王昌庆

联系人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn

6） 泛华普益基金销售有限公司注册地址：四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室办公地址：四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室法定代表人：于海锋

联系人：黄飚

客户服务电话：400-8878-566

网址：www.pyfund.cn

7） 和讯信息科技有限公司注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层法定代表人：王莉

联系人：于扬

客户服务电话：400-920-0022 网址：licaike.hexun.com

8） 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

9） 南京苏宁基金销售有限公司注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号法定代表人：刘汉青

联系人：王锋

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

10） 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋法定代表人：汪静波

联系人：朱了

客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com

11） 上海长量基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层法定代表人：张跃伟

联系人：张佳琳

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com/websiteIII/html/index.html

12） 上海好买基金销售有限公司注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903～906 室法定代表人：杨文斌

联系人：王诗玥

客户服务电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com

13） 上海汇付金融服务有限公司注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼法定代表人：金佶

联系人：钱诗雯

客户服务电话：440-8202-819 网址：www.chinapnr.com

14）上海陆金所资产管理有限公司注册地址：上海市浦

东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼办公地址：上海市浦东

新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼法定代表人：郭坚

联系人：何雪

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lu.com

15） 上海天天基金销售有限公司注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2

号楼 2 层办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼法定代表人：其

实联系人：高莉莉

客户服务电话：400-1818-188 网址：www.1234567.com.cn

16） 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司注册地址：深圳市福田区华强北

路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技

园 4 栋 10 层 1006# 法定代表人：马令海

联系人：邓洁

客户服务电话：010-58325327

网址：8.jrj.com.cn

17） 深圳众禄基金销售有限公司注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股

置地大厦 8 楼办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 法定

代表人：薛峰联系人：邓爱萍

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn、 www.jjmmw.com

18） 天相投资顾问有限公司注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室法定代表人：林义相

联系人：谭磊

客户服务电话：010-66045678 网址：www.jjm.com.cn/

19） 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809 法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

客户服务电话：400-6099-500 网址：www.yixinfund.com

20） 浙江金观诚财富管理有限公司注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室办公地址：杭州市拱墅区登云路 55 号锦昌大厦 1 号楼 1 楼金观法定代表人：徐黎云

联系人：来舒岚

客户服务电话：400-068-0058 网址：www.jincheng-fund.com

21） 浙江同花顺基金销售有限公司注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

客户服务电话：(0571)56768888

网址：www.5ifund.com

22） 中期时代基金销售（北京）有限公司注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

客户服务电话：400-8888-160 网址：www.cifcofund.com

23） 众升财富（北京）基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人：李招弟

联系人：李艳

客户服务电话：400-059-8888 网址：www.zscffund.com

24） 珠海盈米财富管理有限公司注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

（二） 注册登记机构

名称：鹏华基金管理有限公司住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层法定代表人：何如

办公室地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层联系电话：（0755）82021106

传真：（0755）82021165

负责人：吴群莉

（三） 律师事务所

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼法定代表人：俞卫锋

办公室地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼联系电话：021-31358666

传真：021-31358600 联系人：陈颖华

经办律师：吕红、黎明

（四） 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼法定代表人：杨绍信

办公室地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800 联系人：陈熹

经办会计师：许康玮、陈熹

六、基金份额的分级

（一）概要

本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即丰信 A 基金份额（基金份额简称“丰信 A”）和丰信 B 基金份额（基金份额简称“丰信 B”）。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配外，每份丰信 A 和每份丰信 B 享有同等的权利和义务。此外，所有法律法规涉及的关于基金份额的占比的计算，包括但不限于认购或持有基金份额的上限、参加基金份额持有人大会各种表决计票等，两级基金的基金份额应单独进行计算，且两级基金在各自级别基金中的基金份额占比均满足条件方为有效。

丰信 A 和丰信 B 分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比，所募集的两级基金的基金资产合并运作。

（二）基金份额的配比丰信 A 与丰信 B 两级基金的基金份额的初始配比不高于 7:3。

基金管理人将于丰信 A 的申购开放日对丰信 A 进行基金份额折算，丰信 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的丰信 A 份额数按折算比例相应增减。

基金管理人将于丰信 B 的申购赎回开放日的下一个工作日对丰信 B 进行基金份额折算，丰信 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的丰信 B 份额数按折算比例相应增减。

开放日结束后，两级基金的份额配比将根据申购份额与赎回份额实际成交确认情况重新进行确定。两级份额的基金份额配比计算结果保留至小数点后第 9 位，小数点第 9 位以后

的部分四舍五入。在每次开放后，根据丰信 A 份额和丰信 B 份额的折算和申购、赎回情况可能会出现两级份额配比大于或小于 7:3 的情形。

（三）丰信 A 的运作

1、收益率

自基金合同生效之日起，丰信 A 约定年收益率为一年期银行定期存款利率（税后）+利差。

其中，计算丰信 A 首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效日前第二个工作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；其后丰信 A 每个申购开放日，基金管理人将根据该日前第二个工作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重新调整丰信 A 的约定年收益率，丰信 A 的约定收益采用单利计算，丰信 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。

视国内利率市场变化，基金管理人将在基金合同生效日前 2 个工作日内和丰信 A 的申购开放日开始前 2 个工作日内公告当期适用的约定收益率的利差值。利差值的取值范围为 0%（含）-2%（含）。

本基金净资产优先分配予丰信 A 份额的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予丰信 B 份额。基金管理人并不承诺或保证每次开放时丰信 A 份额持有人的约定应得收益，即如本基金资产出现极端损失情况下，丰信 A 份额仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

2、开放日

自基金合同生效之日起，丰信 A 自基金合同生效之日起每半年开放一次，每次开放两个工作日。自基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日为申购开放日，申购开放日的前一工作日为赎回开放日。申购开放日只可提交丰信 A 的申购申请，赎回开放日只可提交丰信 A 的赎回申请。基金管理人公告暂停申购或赎回时除外。

因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金无法按时开放丰信 A 的申购或赎回的，开放日顺延至不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起。

例如，本基金基金合同于 2013 年 7 月 19 日生效，丰信 A 的第一次申购开放日和赎回开放日分别为 2014 年 1 月 17 日（因 2014 年 1 月 18 日为非工作日）和 2014 年 1 月 16 日，丰信 A 的第二次申购开放日和赎回开放日分别为 2014 年 7 月 18 日和 2014 年 7 月 17 日。以此类推。

具体的开放日规定详见招募说明书或以基金管理人届时的公告为准。

3、基金份额折算

本基金基金合同生效之日起，丰信 A 将按以下规则进行基金份额折算。

（1）折算基准日

丰信 A 的基金份额折算基准日与其申购开放日为同一个工作日。

（2）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的丰信 A 所有份额。

（3）折算频率

自基金合同生效之日起每满半年折算一次。

（4）折算方式

折算基准日日终，丰信 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的丰信 A 的份额数按照折算比例相应增减。

丰信 A 的基金份额折算公式如下：丰信 A 的折算比例＝折算基准日折算前丰信 A 的基金份额净值 / 1.000 丰信 A 经折算后的份额数＝折算前丰信 A 的份额数×丰信 A 的折算比例

用于计算折算比例的基金份额净值保留到小数点后第 8 位，丰信 A 份额折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前丰信 A 的基金份额净值、丰信 A 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

（5）基金份额折算的公告

1） 基金份额折算方案须最迟于实施日前 2 日在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

2） 基金份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

4、规模限制

本基金基金合同生效之日起，丰信 A 与丰信 B 的份额配比原则上不超过 7:3。具体规模限制及其控制措施见招募说明书、基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

（四）丰信 **B** 的运作

1、剩余收益

本基金在扣除丰信 A 的应计收益后的全部剩余收益归丰信 B 享有，亏损以丰信 B 的资产净值为限由丰信 B 承担。

2、开放日

丰信 B 自基金合同生效之日起每年开放一次，每次开放一个工作日。自基金合同生效之日起每满一年的最后一个工作日的前一工作日为丰信 B 的申购赎回开放日，供投资者提交申购赎回申请。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放丰信 B 的申购与赎回的，其开放日顺延至不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。例如，本基金基金合同于 2013 年 7 月 19 日生效，丰信 B 的第一次开放日为 2014 年 7 月 17 日，丰信 B 的第二次开放日为 2015 年 7 月 16 日（因 2015 年 7 月 18 日为非工作日）。

以此类推。

具体的开放日规定详见招募说明书或以基金管理人届时的公告为准。

3、基金份额折算

本基金基金合同生效之日起，丰信 B 将按以下规则进行基金份额折算。

（1）折算基准日

丰信 B 的基金份额折算基准日为丰信 B 的申购赎回开放日的下一个工作日。

（2）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的丰信 B 所有份额。

（3）折算频率

自基金合同生效之日起每年折算一次。

（4）折算方式

折算基准日日终，丰信 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的丰信 B 的份额数按照折算比例相应增减。

丰信 B 的基金份额折算公式如下：

丰信 B 的折算比例＝折算基准日折算前丰信 B 的基金份额净值／1.000 丰

信 B 经折算后的份额数＝折算前丰信 B 的份额数×丰信 B 的折算比例

用于计算折算比例的基金份额净值保留到小数点后第 8 位，丰信 B 份额折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前丰信 B 的基金份额净值、丰信 B 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

（5）基金份额折算的公告

1） 基金份额折算方案须最迟于实施日前 2 日在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

2） 基金份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

4、规模限制

本基金基金合同生效之日起，丰信 A 与丰信 B 的份额配比原则上不超过 7:3。具体规模限制及其控制措施见招募说明书、基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

（五）本基金基金份额净值的计算

T 日基金份额净值＝T 日闭市后的基金资产净值 / T 日基金份额的余额数量

T 日基金份额的余额数量为丰信 A 和丰信 B 的份额总额。基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（六）丰信 A 和丰信 B 的基金份额净值计算

按照上述本基金资产及收益分配规则，自基金合同生效之日起在丰信 A 的赎回开放日计算丰信 A 的基金份额净值；在丰信 B 的申购赎回开放日计算丰信 B 的基金份额净值。

设第 T 日为基金份额净值计算日，Ta 为自丰信 A 份额上一次申购开放日（若之前尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数，NV_T为 T 日闭市后的基金资产净值，Fa 为 T 日丰信 A 的份额余额，Fb 为 T 日丰信 B 的份额余额，NAVa 为第 T 日丰信 A 的基金份额净值，NAVb 为第 T 日丰信 B 的基金份额净值，Ra 为丰信 A 约定年收益率，Y 为本基金运作当年实际天数，即丰信 A 上一次申购开放日（如 T 日之前无申购开放日，则为基金成立日）所在年度的实际天数。自基金合同生效之日起，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于丰信 A 和丰信 B 基金份额净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

自基金合同生效之日起第 T 日，丰信 A 和丰信 B 的基金份额净值计算公式如下：

（1） 当NV_T＜Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）时，则丰信 A 与丰信 B 在第 T 日基金份额净值为:

NAVa=NV_T/Fa；

NAVb=0；

（2） 当Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）≤NV_T时，则丰信 A 与丰信 B 在第 T 日基金份额净值为:

NAVa＝1.00×（1+Ra×Ta/Y）；

NAVb=（NV_T -NAVa×Fa）/Fb； 丰信 A 与丰信 B 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。

例：设在本基金《基金合同》生效后丰信 A 的第二个赎回开放日，自丰信 A 上一次申购开放日起的运作天数为 180 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，基金资产净值为 35 亿元，丰信 A、丰信 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，丰信 A 上一次开放日设定的丰信 A 年收益率为 4.2%。则丰信 A、丰信 B 的基金份额净值计算如下：丰信 A 的基金份额净值＝1.00×（1+4.2%×180/365）＝1.021 元

丰信 B 的基金份额净值＝（35-1.02071233×21）/9＝1.507 元

（七）丰信 A 和丰信 B 基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算并公告丰信 A 和丰信 B 基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

丰信 A 和丰信 B 基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

设第 T 日为基金份额参考净值计算日，Ta 为自丰信 A 份额上一次申购开放日（若之前尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数，NV_T为 T 日闭市后的基金资产净值，Fa 为 T 日丰信 A 的份额余额，Fb 为 T 日丰信 B 的份额余额， NAVa 为第 T 日丰信 A 的基金份额参考净值，NAVb 为第 T 日丰信 B 的基金份额参考净值，Ra 为丰信 A 约定年收益率，Y 为本基金运作当年实际天数，即丰信 A 上一次申购开放日（如 T 日之前无申购开放日，则为基金成立日）所在年度的实际天数。基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于丰信

A 和丰信 B 基金份额参考净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

自基金合同生效之日起第 T 日，丰信 A 和丰信 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

（1） 当 NV_T＜Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）时，则丰信 A 与丰信 B 在第 T 日基金份额参考净值为:

NAVa=NV_T/Fa；

NAVb=0；

（2） 当 Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）≤NV_T时，则丰信 A 与丰信 B 在第 T 日基金份额参考净值为:

NAVa＝1.00×（1+Ra×Ta/Y)；

NAVb=（NV_T -NAVa×Fa）/Fb；

丰信 A 与丰信 B 基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

例：本基金《基金合同》生效之日起，设自丰信 A 上一次申购开放日起的运作天数为 60 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，基金资产净值为 31 亿元，丰信 A、丰信 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，丰信 A 上一次开放日设定的丰信 A 年收益率为 4.2%。则丰信 A、丰信 B 的基金份额参考净值计算如下：

丰信 A 的基金份额参考净值＝1.00×（1+4.2%×60/365） ＝1.007 元

丰信 B 的基金份额参考净值＝（31-1.007×21）/9＝1.095 元

七、基金的募集与基金合同的生效

（一）基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2013 年 7 月 18 日证监许可[2013]938 号文核准募集。募集期间有效认购份额 590,382,493.66 份，利息结转份额 85,925.14 份，合计 590,468,418.80 份 ，募集户数为 729 户。

（二）基金的类型债券型证券投资基金

（三）基金的类型

契约型。

本基金采取永续分级的方式运作。其中，丰信 A 自基金合同生效日起每半年开放一次申购赎回，每次开放两个工作日，于丰信 A 的申购开放日仅接受申购申请，于丰信 A 的赎回开放日仅接受赎回申请；丰信 B 自基金合同生效之日起每年开放一次，每次开放一个工作日，于丰信 B 的申购赎回开放日接受投资者的申购和赎回。

（四）基金的类型

不定期

（五）基金的类型

本基金的基金合同已于 2013 年 10 月 22 日正式生效。

（六）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额《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。

八、基金份额的申购与赎回

（一）丰信 A、丰信 B 的申购与赎回

自本基金合同生效之日起，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即丰信 A 份额和丰信 B 份额。其中，丰信 A 自基金合同生效日起每半年开放一次申购赎回，每次开放两个工作日，于丰信 A 的申购开放日仅接受申购申请，于丰信 A 的赎回开放日仅接受赎回申请；丰信 B 自基金合同生效之日起每年开放一次，每次开放一个工作日，于丰信 B 的申购赎回开放日接受投资者的申购和赎回。

1.申购与赎回的开放日

（1）丰信 A 的申购开放日与赎回开放日

本基金办理丰信 A 的申购的开放日为自基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日，办理丰信 A 的赎回的开放日为丰信 A 的申购开放日的前一个工作日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外，开放日的具体计算见基金合同第四部分“丰信 A 的运作”的相

关内容。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放丰信 A 的申购或赎回的，开放日顺延至不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起。

丰信 A 的开放日以及开放日办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

（2）丰信 B 的申购赎回开放日

本基金办理丰信 B 的申购赎回开放日为自基金合同生效之日起每满一年的最后一个工作日的前一工作日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外，开放日的具体计算见基金合同第四部分“丰信 B 的运作”的相关内容。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放丰信 B 的申购与赎回的，其开放日顺延至不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起。

丰信 B 的开放日以及在开放日办理丰信 B 的申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

2.申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和具有基金销售资格、与基金管理人签订了基金销售协议的其他销售机构。基金投资人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本基金的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。

3.申购与赎回的原则

（1） 丰信 A 的申购采用“确定价”原则，即丰信 A 的申购价格以人民币 1.00 元为基准进行计算；丰信 A 的赎回采用“未知价”原则，即丰信 A 的赎回价格以受理申请当日的丰信 A 的基金份额净值为基准进行计算；丰信 B 的申购和赎回采用“未知价”原则，即基金份额的申购与赎回价格以受理申请当日丰信 B 的基金份额净值为基准进行计算；

（2） “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3） 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销；

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

（5） 基金管理人、基金登记机构可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

4.申购与赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金销售机构规定的程序，在丰信 A 的申购开放日的业务办理时间向基金销售机构提出丰信 A 的申购申请，在丰信 A 的赎回开放日的业务办理时间向基金销售机构提出丰信 A 的赎回申请；在丰信 B 的开放日的业务办理时间向基金销售机构提出丰信 B 的申购与赎回申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交本基金的赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

（2）申购和赎回申请的确认时间

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购或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 日内对丰信 A 或丰信 B 的申购、赎回的有效性进行确认，T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《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。

（3）申购和赎回申请的成交确认原则每个开放日的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

基金销售机构对基金的申购与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。基金的申购与赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。

1）丰信 A 单独开放申购赎回在丰信 A 的赎回开放日，所有经确认有效的丰信 A 的赎回申请全部予以成交确认。

在丰信 A 的申购开放日，本基金以丰信 B 的份额余额为基准，在丰信 A 和丰信 B 的份额配比不超过 7:3 的范围内对丰信 A 的申购进行确认。

对于丰信 A 的申购申请，如果对丰信 A 的全部有效申购申请进行确认后，丰信 A 与丰信 B 的份额配比小于或等于 7:3，则所有经确认有效的丰信 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对丰信 A 的全部有效申购申请进行确认后，丰信 A 与丰信 B 的份额配比超过 7:3，则在经确认后的丰信 A 与丰信 B 的份额配比不超过 7:3 的范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

丰信 A 单独开放申购赎回时的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

2）丰信 A 和丰信 B 同时开放申购赎回

对丰信 B 的有效申购与赎回申请以及丰信 A 的有效赎回申请进行确认，并对丰信 A 和丰信 B 的基金份额分别进行折算后，对丰信 A 的有效申购申请分以下三种情形进行处理：

1） 如果丰信 A 与丰信 B 的份额配比等于 7:3，则对丰信 A 的有效申购申请全部不予确认；

2） 如果丰信 A 与丰信 B 的份额配比超过 7:3，则对丰信 A 的有效申购申请全部不予确认，并按照丰信 A 与丰信 B 的份额配比等于 7:3 的原则，对丰信 A 的份额余额进行按比例强制赎回； 3）如果丰信 A 与丰信 B 的份额配比小于 7:3，则按照丰信 A 与丰信 B 的份额配比等于 7:3 的原则，对丰信 A 的有效申购申请进行按当日申请比例进行成交确认，而不会对丰信 A 既有的份额余额进行强制赎回。

丰信 A 和丰信 B 在同时开放申购赎回时的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

（4）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，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，申购款项将退回投资人账户，由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金登记机构及其相关基金销售机构在 T＋7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

5.申购与赎回的数额限制

（1） 本基金对单个基金份额持有人不设置最高申购金额限制和累计持有基金份额上限。

（2） 投资人通过销售机构申购丰信 A 或丰信 B，单笔最低申购金额为 10 元(含申购费)。

通过基金管理人直销中心申购丰信 A 或丰信 B，首次最低金额为 100 万元，追加申购单笔最低金额为 1 万元（通过本基金管理人基金网上交易系统等特定交易方式申购暂不受此限制)。若发生比例确认，申购金额不受最低申购金额限制。各销售机构可根据业务情况设置高于或等于本公司设定的上述单笔申购最低金额，如果销售机构业务规则规定的最低单笔

申购金额高于 10 元人民币，以销售机构的规定为准。投资者办理相关业务时，请遵循销售机构的具体业务规定。

（3） 丰信 A 或丰信 B 的单个交易账户最低余额为 5 份基金份额，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的单只基金份额余额不足 5 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。

（4） 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

6.申购费用和赎回费用

（1）申购费用

丰信 A 的申购费率为 0。丰信 B 的申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。丰信 B 的申购费率如下：本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金丰信 B 的养老金客户适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额 M（元）	一般申购费率	特定申购费率
M<100 万	0.6%	0.24%
100 万≤ M <500 万	0.3%	0.09%
M≥ 500 万	每笔 1000 元	每笔 1000 元

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

丰信 B 的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。 费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前依照《信息披

露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。 对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以对丰信 B 采用低于柜台交易方式的申购费率，并另行公告。

（2）赎回费率

1）丰信 A 的赎回费

丰信 A 的赎回费率按照持有期限递减，即持有期限越长，所适用的赎回费率越低。丰信 A 持有期限为丰信 A 的一个开放周期的，赎回费率为 0.1%；持有期限超过丰信 A 的 1 个开放周期的，赎回费率为 0。赎回费全额归入基金资产。

2）丰信 B 的赎回费 丰信 B 的赎回费率为 0。

（3） 本基金的申购费率、赎回费率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。基金管理人和基金托管人协商后，可以根据《基金合同》的相关约定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。

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

（5） 在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别、增加新的收费方式等情况，可由基金管理人和基金托管人协商，并报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

7.申购份额与赎回金额的计算

（1）申购份额的计算

1）丰信 A 申购份额的计算方法如下： 申购份额＝申购金额/1.00

上述各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：在丰信 A 的申购开放日，某投资者投资 10,000 元申购丰信 A，则其可得到的丰信 A 份额计算如下：

申购份额＝10,000/1.00＝10,000 份

2）丰信 B 申购份额的计算方法如下：

丰信 B 的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

净申购金额 =申购金额/（1＋申购费率）申购费用=申

购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日丰信 B 的基金份额净值

申购的有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：在丰信 B 的开放日，某投资人（非养老金客户）投资 5 万元申购本基金丰信 B 份额，对应费率为 0.6%，假设申购当日丰信 B 的基金份额净值为 1.050 元,则可得到的丰信 B 的申购份额为：

净申购金额＝50,000/（1＋0.6%）＝49,701.79 元

申购费用＝50,000－49,701.79＝298.21 元申购份额＝

49,701.79/1.050＝47,335.04 份

即：投资人投资 5 万元申购本基金丰信 B 份额，假设申购当日丰信 B 的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到 47,335.04 份基金丰信 B 份额。

（2）赎回金额的计算

1）丰信 A 赎回金额的计算方法如下：

丰信 A 按照持有期限收取赎回费用，丰信 A 的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额=赎回份额 赎回当日基金份额净值赎回费用=赎回总金额 赎回费

率

净赎回金额=赎回总金额 赎回费用

赎回金额单位为元，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资人赎回本基金 1 万份丰信 A 份额，持有时间为丰信 A 的一个开放周期，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日丰信 A 的基金份额净值是 1.021 元，则其可得到的丰信 A 的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.021=10,210 元赎回费用=10,210×0.1%=10.21

元

净赎回金额=10,210-10.21=10,199.79 元

即：投资人赎回本基金 1 万份丰信 A 基金份额，持有期限为丰信 A 的一个开放周期，假设赎回当日丰信 A 的份额净值是 1.021 元，则其可得到的丰信 A 的净赎回金额为 10,199.79 元。

2）丰信 B 赎回金额的计算方法如下：

丰信 B 不收取赎回费用，赎回金额的计算公式为： 赎回金

额＝赎回份额×T 日丰信 B 的基金份额净值

上述各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：在丰信 B 的开放日，某投资人赎回 500,000 份，假设申购当日丰信 B 的基金份额净值为 1.008 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额＝500,000.00×1.008＝500,400.00 元

8.拒绝或暂停申购的情形及处理方式

在丰信 A 或丰信 B 开放时，除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资人对丰信 A 或丰信 B 的申购申请：

（1） 不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2） 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

（3） 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的利益；

（4） 根据申购规则和程序导致部分或全部申购申请没有得到成交确认；

（5） 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

（6） 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资人。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

9.暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

（1）在丰信 A 或丰信 B 开放时，除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人对丰信 A 或丰信 B 的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3）本基金在开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生除上述第 3）条以外的情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已确认成功的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。若出现上述第 3）项所述情形，按基金合同的相关条款处理。

10、巨额赎回的情形及处理形式

基金合同生效之日起丰信 A 或丰信 B 开放时，依本合同约定的申购与赎回申请的确认原则进行申购与赎回申请的成交确认后，丰信 A 的净赎回份额（赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额）与丰信 B 的净赎回份额（赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额，如有）的总和超过本基金前一日基金总份额的 10%时的情形，称为本基金

的巨额赎回。

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定支付全部赎回款项或延期支付部分赎回款项。

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

（2） 延期支付部分赎回款项：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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日基金资产净值的 10%的前提下，对其余已经接受的有效赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体公告。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额。

（3） 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付赎回款项时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体或基金销售机构的网点刊登公告。

11、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，并在规定期限内在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 个开放日的基金份额净值。

（3） 如发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

（二）基金转换

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

（三）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户(可补充其他情况)。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

（四）基金的转托管

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

（五）定期定额投资计划

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

（六）基金的冻结和解冻

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

九、基金的投资

（一）投资目标

通过对宏观经济和固定收益市场的研究分析，在严格控制风险的基础上采取积极主动的投资策略，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购、中小企业私募债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或股票增发，并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

基金管理人将采取积极的投资策略，寻找各种可能的价值增长机会，力争实现超越基准的投资收益。

（1）资产配置策略

在大类资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析，结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测，比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率，在债券、股票一级市场及现金类资产之间进行动态调整。

（2）普通债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、利差策略等积极投资策略,在追求本金长期安全的基础上，力争为投资人创造更高的总回报。

1）久期策略

本基金将通过自上而下的组合久期管理策略，以实现对组合利率风险的有效控制。基金管理人将根据对宏观经济周期所处阶段及其它相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

2）收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一， 本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测,适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

3）骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

4）息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

5）利差策略

本基金通过对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势作出判断，进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，则进行相反的操作。

（3）附权债券投资策略

本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。

1）可转债投资策略

可转债具有债权的属性，投资人可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；也具有期权的属性，可以在规定的时间内将可转债转换成股票，享受股票分红或套现。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。

2）其他附权债券投资策略

本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将结合市场状况、债券具体条款重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

（4）中小企业私募债的投资策略

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金将在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力避免可能存在的债券违约。

（5）资产证券化产品投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

（6）新股申购策略

本基金根据新股发行人的基本情况，结合对认购中签率和新股上市后表现的预期，谨慎参与新股申购，获取股票一级市场与二级市场的价差收益，申购所得的股票在可上市交易或流通受限解除后不超过 3 个月的时间内卖出。

（四）投资决策依据

1. 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

2. 国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策；

3.固定收益市场发展及各类属间利差情况；

4.各行业发展状况、市场波动和风险特征；

5.上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势；

6.证券市场走势。

（五）投资决策流程

1.投资决策委员会：确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

2.基金经理（或管理小组）：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

3.信用分析研究员：采用自上而下的信用产品分析模式,分别从宏观、行业和公司三个层面对信用债券所面临的信用风险进行分析，维护公司信用库，给基金经理投资建议。

4.集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

5.绩效与风险评估小组：对基金投资组合进行评估，向基金经理（或管理小组）提出调整建议。

6.监察稽核部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并在基金招募说明书更新中予以公告。

（六）业绩比较基准本基金业绩比较基准为：中债总指数收益率。

中债总指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益。本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，为此，本基金选取中债总指数作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人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，但不需要召集基金份额持有人大会。

（七）风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，丰信 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；丰信 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

（八）投资禁止行为与限制

1. 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）向他人贷款或者提供担保；（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

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

（7） 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8） 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后，则本基金不受上述规定的限制。

2. 基金投资组合比例限制

（1） 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80％；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；

（2） 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10％；

（3） 本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

（4） 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5） 在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全

部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

（6） 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；

（7） 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（8） 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%；本公司管理的全部证券投资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%；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%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；（9）本基金参与股票发行申购的，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

（10） 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%；

（11） 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

（12） 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。

法律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，则本基金投资不再受相关限制。

（九） 基金管理人代表基金行使股东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股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3.有利于基金财产的安全与增值；

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

（十） 基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

（十一）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,261,196,691.60	93.11
	其中：债券	1,261,196,691.60	93.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	41,530,243.55	3.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,187,821.11	1.86
8	其他资产	26,575,173.23	1.96
9	合计	1,354,489,929.49	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1） 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 注：无。

（2） 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 注：无。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,110,000.00	3.70
	其中：政策性金融债	50,110,000.00	3.70
4	企业债券	798,619,911.60	59.01
5	企业短期融资券	371,621,000.00	27.46
6	中期票据	40,484,000.00	2.99
7	可转债（可交换债）	361,780.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,261,196,691.60	93.19

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011761026	17 柯桥国资 SCP002	1,300,000	130,572,000.00	9.65
2	122806	11 渭南 02	504,000	50,883,840.00	3.76
3	041662053	16 沪世茂 CP002	500,000	50,230,000.00	3.71
4	150207	15 国开 07	500,000	50,110,000.00	3.70
5	112323	16 投资 01	500,000	47,960,000.00	3.54

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

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

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细　注：无。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）　本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（2）　报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细　注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（3）　本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

10、投资组合报告附注

（1）　本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

（2）

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）　其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	369,644.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,205,528.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,575,173.23

（4）　报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	128013	洪涛转债	101,190.00	0.01

（5）　报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明　注：无。

（6） 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十、 基金的业绩

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

	净值增长率 1	净值增长率标准差 2	业绩比较基准收益率 3	业绩比较基准收益率标准差 4	1-3	2-4
2013 年 10 月 22 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	-0.80%	0.18%	-2.12%	0.15%	1.32%	0.03%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	20.67%	0.26%	11.23%	0.15%	9.44%	0.11%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	14.52%	0.34%	8.03%	0.11%	6.49%	0.23%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2.27%	0.12%	1.30%	0.12%	0.97%	0.00%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	1.49%	0.08%	-0.32%	0.09%	1.81%	-0.01%
自基金合同生效日至 2017 年 9 月 30 日	42.69%	0.23%	18.76%	0.13%	23.93%	0.10%

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的处分

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

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十二、基金资产的估值

（一）估值日

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

（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2） 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环

境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3） 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4） 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2） 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

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

4、 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。

5、 中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

6、 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

本基金自基金合同生效日起，基金管理人在基金资产净值计算的基础上，按照基金合同的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告丰信 A 和丰信 B 基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。丰信 A 和丰信 B 基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

丰信 A 的每个赎回开放日和丰信 B 的每个开放日，按照基金合同的规定对于丰信 A 和丰信 B 分别进行基金份额净值计算。丰信 A 和丰信 B 基金份额净值的计算，各自保留小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值、两级基金份额的基金份额参考净值，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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3） 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4） 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

（5） 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6） 如果出现估值错误的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、

《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7） 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

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

（2） 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

（3） 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）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。

（七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考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交易日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（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 6 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。

十三、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

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

（二）基金收益分配的原则

本基金自基金合同生效之日起，收益分配应遵循下列原则：

（1）本基金（包括丰信 A 和丰信 B）不进行收益分配；　（2）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

十四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；　2、基金托管人的托管费；

3、丰信 A 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、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.4 %÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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.丰信 A 销售服务费

自本基金合同生效之日起，丰信 A 收取销售服务费，丰信 B 不收取销售服务费。丰信 A 的销售服务费年费率为 0.35%。

丰信 A 销售服务费计提的计算公式如下：

H=E×0.35%÷当年天数

H 为丰信 A 每日应计提的销售服务费

E 为前一日丰信 A 基金份额参考净值或基金份额净值与丰信 A 份额数的乘积

丰信 A 销售服务费费每日计算，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丰信 A 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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

自 2017 年 3 月 6 日起，基金管理人对鹏华丰信分级债券型证券投资基金 A 类份额开展销售服务费费率优惠活动，销售服务费费率由 0.35%调整为 0.01%。

上述“一、基金费用的种类中第 4－9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目下列费用不列入基金费用：

1、 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、 《基金合同》生效前的相关费用；

4、 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四） 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（五） 基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、 基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、 基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、 会计制度执行国家有关会计制度；

5、 本基金独立建账、独立核算；

6、 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1、 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

十六、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）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。本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2.对证券投资业绩进行预测；

3.违规承诺收益或者承担损失；

4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；

5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6.中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

一、公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1.《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2.基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、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。

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

基金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。

（二）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。

（三）《基金合同》生效公告基金管理人应当在收到基金合同生效的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

（四）两级基金的基金份额配比在基金定期报告中，基金管理人应当计算并公告两级基金的基金份额配比。

（五）基金资产净值、基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值

基金合同生效后，在首次办理丰信 A 的申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、丰信 A 和丰信 B 的基金份额参考净值以及本基金的基金份额净值。

在首次办理丰信 A 的申购或者赎回后，基金管理人应当在每个工作日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露丰信 A 和丰信 B 的基金份额参考净值以及本基金的基金份额净值。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、丰信A、丰信 B 和本基金的基金份额（参考）净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、丰信 A、丰信 B 和本基金的基金份额（参考）净值登载在指定媒体上。

（六）基金份额申购、赎回价格

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

（七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

（八）中小企业私募债券的投资情况

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒体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。

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

（九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

（1）基金份额持有人大会的召开；

（2）终止《基金合同》；（3）转换基金运作方式；

（4） 更换基金管理人、基金托管人；

（5） 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（6） 基金管理人股东及其出资比例发生变更；

（7） 基金募集期延长；

（8） 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

（9） 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；

（10） 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；

（11） 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

（12） 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

（13） 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

（14） 重大关联交易事项；

（15） 基金收益分配事项；

（16） 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（17） 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

（18） 本基金办理丰信 A、丰信 B 申购、赎回的开放日；

（19） 基金改聘会计师事务所；

（20） 变更基金销售机构；

（21） 更换基金登记机构；

（22） 本基金开始办理申购、赎回；

（23） 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

（24） 本基金发生巨额赎回并延期支付；

（25） 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

（26） 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

（27） 发生对丰信 A 的强制赎回；

（28） 中国证监会规定的其他事项。

（十） 澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（十一）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。

（十二）中国证监会规定的其他信息。

二、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值和两级基金份额的基金份额参考净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

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

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

三、信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十七、风险揭示

本基金的风险主要包括：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险及其他风险等。

（一）系统性风险

本基金投资于证券市场，系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险和购买力风险等。

1.政策风险

政策风险是指政府有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的举措、法规出台，引起债券价格的波动，从而给投资带来的风险。

2.经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

3.利率风险利率风险是指由市场利率变化给投资人带来收益损失的可能性。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的，当市场利率上升时，会吸引一部分资金流向银行储蓄等其他金融资产，减少对债券的需求，债券价格将下跌；当市场利率下降时，一部分资金流回债券市场，增加对债券的需求，债券价格将上涨。一般而言，投资购买的债券离到期日越长，则利率变动对债券价格的影响越大，其利率风险也相对越大。

4.购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

5.再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升带来的价格风险互为消长。在利率走低时，再投资收益率就会降低，再投资的风险加大。当利率上升时，债券价格会下降，但是利息的再投资收益会上升。

（二）非系统性风险非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

1.公司经营风险

公司的经营受多种因素影响。基金所投资债券对应的公司经营不善，能够用于分配的利润减少，公司无法偿还债券利息的风险。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

同时，公司经营不善也将导致其股票价格下跌，对本基金的股票投资带来相应损失的风险。

2.信用风险

债券发行人无法按时还本付息，而使投资遭受损失的风险为信用风险。这种风险主要表现在公司债券中，公司如果因为某种原因不能完全履约支付本金和利息，则债券投资就会承受较大的亏损。广义的信用风险不仅指企业的违约风险，还包括市场信用利差扩大及企业信用评级下降的风险。

（三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

（四）流动性风险

基金可能面临基金资产不能迅速、低成本地转变成现金，或者不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险。前者是指金融资产不能及时变现或无法按照正常的市场价格交易而引起损失的可能性。为应付投资人的赎回，基金资产需保持一定的流动性，从而在收益性方面可能会有些损失，影响基金投资目标的实现。后者是指在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金单位净值。

（五）本基金特定风险

1.丰信 A 的特有风险

（1）流动性风险

丰信 A 自基金合同生效之日起每半年开放一次，丰信 A 的持有人只能在丰信 A 的赎回开放日赎回。在非丰信 A 的赎回开放日，丰信 A 的持有人将因不能赎回丰信 A 而出现流动性风险。另外，因不可抗力等原因，丰信 A 的赎回开放日可能延后，导致丰信 A 的持有人不能按期赎回而出现流动性风险。

（2）利率风险

在丰信 A 的每个申购开放日前的第二个工作日，本基金将根据届时执行的一年期银行定期存款利率设定该申购开放日次日起适用的丰信 A 的年约定收益率。如果该申购开放日前的第二个工作日利率下调，丰信 A 的年约定收益率将相应向下调整；如果利率上调没有发生在申购开放日前的第二个工作日，丰信 A 的年约定收益率并不会立即进行相应调整，而是等到下一次开放时再根据实际情况作出调整，从而出现利率风险。

（3）开放时的巨额赎回风险

在丰信 A 每次开放时，若本基金发生巨额赎回，本基金可根据具体情况进行延期支付，丰信 A 的持有人将因此而承担延期支付所导致的风险。

（4）开放时不能完全赎回的风险

在丰信 A 每次开放时，丰信 A 将进行基金份额折算，丰信 A 的持有人可能面临不能赎回由于折算而新增的这部分基金份额的风险。

（5）极端情形下的损失风险

丰信 A 具有低风险、收益相对稳定的特征，但是，基金管理人并不承诺或保证丰信 A 的约定收益，在极端情形下，比如基金资产在短期内发生大幅度的投资亏损时，丰信 A 的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

（6）强制赎回风险

丰信 A 和丰信 B 份额同时开放申购赎回时，出于保护投资人利益，恢复基金份额配比目标值，需要对丰信 A 和丰信 B 的份额配比进行比例控制（不超过 7：3），因此，丰信 A 持有人有可能面临既有份额被强制按比例赎回的风险。

2.丰信 B 的特有风险

（1）杠杆机制风险

本基金在扣除丰信 A 的本金、应计收益后的全部剩余资产归丰信 B 享有，亏损以丰信 B 的资产净值为限由丰信 B 首先承担。因此，丰信 B 在可能获取放大的基金资产增值收益预期的同时，也将承担基金投资的全部亏损，在极端情形下，丰信 B 可能遭受全部的投资损失。

（2）利率风险

在丰信 A 的每个开放日前的第二个工作日，本基金将根据届时执行的一年期银行定期存款利率设定该开放日次日起适用的丰信 A 的年约定收益率，如果该开放日前的第二个工

作日利率上调，丰信 A 的年约定收益率将相应向上调整，本基金在扣除丰信 A 的本金、应计收益后的全部剩余资产将减少，从而出现利率风险。

（3）杠杆率变动风险

由于丰信 B 内含杠杆机制，基金资产净值的波动将以一定的杠杆倍数反映到丰信 B 的基金份额参考净值的波动上。但是，丰信 B 的杠杆率并不是固定的，而是取决于两级基金份额的份额配比以及两级份额的基金份额参考净值。若丰信 A 与丰信 B 的份额配比越小或丰信 B 的基金份额参考净值越高，则杠杆率越低，收益放大效应越弱，从而产生杠杆率变动风险。

3.中小企业私募债券风险

（1） 信用风险：中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、

内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性，从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（2） 流动性风险：中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制，存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

（六）其他风险

1.因技术因素而产生的风险，如电脑系统出现故障产生的风险；

2.战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

3.其他意外导致的风险。

十八、基金的终止与清算

（一）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、 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（二）基金财产的清算

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

2、 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、 基金财产清算程序：

（1） 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2） 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3） 对基金财产进行估值和变现；

（4） 制作清算报告；

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

（6） 将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7） 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，根据基金合同“虚拟清算”的原则计算并确定丰信 A 和丰信 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对丰信 A 和丰信 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

8、基金财产清算的公告

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

9、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。

十九、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务 基金份额持有人的权利、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。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；（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。

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；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、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）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。

基金管理人的权利、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；

（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） 召集基金份额持有人大会；

（6） 依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了

《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7） 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8） 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的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；

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

（13） 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

（17） 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1） 依法募集基金，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，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9） 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10） 编制季度、半年度和年度基金报告；

（11） 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12） 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

（14） 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15） 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16） 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

（18） 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19） 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（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。

基金托管人的权利、义务

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

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

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

（3） 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，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。

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

（1） 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

（4） 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己

及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6） 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7） 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8） 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9） 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10） 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行

《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11） 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12） 建立并保存基金份额持有人名册；

（13） 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14） 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（15） 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金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。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则 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。

基金份额持有人大会的审议事项应分别由丰信 A、丰信 B 基金份额持有人独立进行表决。丰信 A、丰信 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1） 终止《基金合同》；

（2） 更换基金管理人；

（3） 更换基金托管人；

（4） 转换基金运作方式；

（5） 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6） 变更基金类别；

（7） 本基金与其他基金的合并；

（8） 变更基金投资目标、范围或策略；

（9） 变更基金份额持有人大会程序；

（10） 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11） 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有丰信 A 和丰信 B 各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人”，并以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12） 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13） 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

（1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（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；

（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；

（5） 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（6） 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。

召集人和召集方式

1、 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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；

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；

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

召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1） 会议召开的时间、地点和会议形式；

（2） 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3） 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4） 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点;

（5） 会务常设联系人姓名及联系电话；

（6） 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7） 召集人需要通知的其他事项。

2、 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

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、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2） 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%，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：

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

（2） 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份

额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3） 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额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，并与基金登记注册机构记录相符；

（5） 会议通知公布前报中国证监会备案。

议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位

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

（2）通讯开会

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

决议形成的条件、表决方式、程序

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：

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的审议事项应分别由丰信 A、丰信 B 基金份额持有人独立进行表决，且丰信 A、丰信 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。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 50% 以上（含 50%）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。一般决议须同时经参加大会的丰信 A、丰信 B 各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上通过方为有效。

2、 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。特别决议须同时经过参加大会的丰信 A、丰信 B 各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

计票

1、现场开会

（1） 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2） 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（三）基金合同变更和终止的事由、程序

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经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1） 基金份额持有人大会决定终止的；

（2） 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3） 《基金合同》约定的其他情形；

（4） 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，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。仲裁地点为北京市。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。

《基金合同》受中国法律管辖。

（五）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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、销售机构和登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

1、基金管理人名称：鹏华基金管理有限公司注册地址：深圳市福

田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层办公地址：深圳

市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层邮政编码：

518048 法定代表人：何如

成立时间：1998 年 12 月 22 日批准设立机关：

中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]31 号

组织形式：（中外合资）有限责任公司注

册资本：1.5 亿元存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

2、基金托管人

名称：上海银行股份有限公司

注册地址： 上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

邮政编码：200120 法定代表人：

金煜

成立日期：1995 年 12 月 29 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号

组织形式： 股份有限公司注册资本：54.04 亿元存续期间：

持续经营

经营范围： 人民币存贷款等

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

（1） 本基金将投资于以下金融工具：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购、中小企业私募债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或股票增发，并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

（2） 本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投融资比例：基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

（1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80％；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10％；

（3）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

（4）在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

（5） 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；

（6） 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

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

（8） 本基金参与股票发行申购的，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

（9） 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

（10）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%；

（11） 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

（12） 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律、法规另有规定时，从其规定。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，则本基金投资不再受相当限制，不需要经基金份额持有人大会审议。

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。

3、 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算。基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4、　基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）　基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）　基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（3）　基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（4）　基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时违反有关法律法规的规定及基金合同的约定，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算，若基金管理人拒不执行造成基金财产损失，基金托管人不承担任何责任。

5、本基金投资中小企业私募债券的应符合证监会《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。（1）基金管理人应在基金首次投资中小企业私募债券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案、信用风险处置预案等。

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

（2）　基金管理人对本基金投资中小企业私募债券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算。

（3） 基金托管人有权根据基金管理人制定的风险控制制度对基金管理人投资中小企业私募债券的额度和比例进行监督。如果基金管理人对相应风险控制制度进行修改的，应及时修订后通知基金托管人。

（4） 基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

如因市场变化，基金管理人投资的中小企业私募债券超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个交易日内将中小企业私募债券调整至规定的比例要求。

6、 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个交易日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

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

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

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

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

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

（3） 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

（4） 基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

8、基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，

本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定基金投资中期票据相关制度（以下简称“《制度》”），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。

（1）基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

1） 中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例及期限限制；

2） 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%；

（2）基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（3）如因市场变化，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个交易日内将中期票据调整至规定的比例要求。

9、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、两级基金份额的基金份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。 10、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、

基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

11、 基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金

合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

12、 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

13、 基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1、 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、两级基金份额的基金份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

3、 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

4、 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1） 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2） 基金托管人应安全保管基金财产。

（3） 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

（5） 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管

人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任基金托管人不承担。

（6） 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

（7） 基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。

（8） 资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益；由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

（9） 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金募集期间及募集资金的验资

（1） 募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的鹏华基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

（2） 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。（3）若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

（1） 基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

（2） 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3） 基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

（1） 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

（2） 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3） 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（4） 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

（5） 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

6、其他账户的开立和管理

（1） 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

（2） 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

（五）基金资产净值的计算和会计核算

1.基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，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。在计算得出基金份额净值后，根据本基金基金合同约定的计算公式，计算两级基金份额的基金份额参考净值。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、基金份额净值、两级基金份额的基金份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值、两级基金份额的基金份额参考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。

3. 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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，

不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

（七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2、基金托管协议终止出现的情形

（1）基金合同终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下服务内容，由基金管理人在正常情况下向投资人提供，基金管理人可根据实际业务情况以及基金份额持有人的需要和市场的变化，不断完善并增加和修改服务项目。

一、营销创新及网上交易服务为丰富投资人的交易方式和渠道，基金管理人为投资人提供多种形式的交易服务。

在营销渠道创新方面，本基金管理人大力发展基金电子商务，并已开通基金网上交易系统，投资人可登陆本基金管理人的网站（www.phfund.com），更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道，为投资人提供更加多样化的交易方式和手段。二、交易资料的寄送服务

基金管理人将向发生交易且基金管理人持有其真实、准确、完整联系方式的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送交易对账单、《鹏友会》等资料。

三、信息定制服务

投资人可以通过基金管理人网站（www.phfund.com）、短信平台、呼叫中心（4006788-999；0755-82353668）等渠道提交信息定制申请，在申请获基金管理人确认后，基金管理人将通过手机短信、E-MAIL 等方式为客户发送所定制的信息。通过手机短信可定制的信息包括：月度短信账单、公司最新公告、持有基金周末净值等；通过邮件定制的信息包括：鹏友会周刊、财经资讯、电子对账单等信息。基金管理人将根据业务发展需要和实际情况，适时调整发送的定制信息内容。

四、在线咨询服务

投资人可通过登录本基金管理人网站进行信息查询，通过输入基金账户号（或证件号码）和查询密码进入查询账户，享有交易查询、信息定制、资料修改、对账单打印、理财刊物查阅等服务。

投资人可通过在线客服、短信接收平台等网络通讯工具进行业务咨询，基金管理人在工作时间内有专人在线提供咨询服务。

五、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心（400-6788-999、0755-82353668）自动语音系统提供每周 7×24 小时基金账户余额、交易情况、基金产品信息与服务等信息查询。

呼叫中心人工坐席提供工作日 8：30－21：00 的座席服务（重大法定节假日除外），投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

六、客户投诉受理服务

投资人可以通过直销和销售机构网点柜台、基金管理人设置的投诉专线、呼叫中心人工热线、书信、电子邮件等渠道，对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

电话、电子邮件、书信、网络在线是主要投诉受理渠道，基金管理人设专人负责管理投诉电话（0755-82353668）、信箱、网络服务。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各销售机构受理后反馈给本基金管理人跟进处理。

二十二、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并至少在一种指定媒体上公告。

公告内容	报纸	日期
2017 年第一季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 4 月 24 日
鹏华丰信分级债券型证券投资基金之丰信 A 份额折算和申购与赎回结果的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 4 月 25 日
鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 5 月 31 日

鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 6 月 1 日
鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 6 月 2 日
鹏华丰信分级债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 6 月 3 日
鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日
鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 7 月 5 日
鹏华基金管理有限公司关于调整直销中心首次认/申购单笔最低金额限制的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 7 月 10 日
2017 年第二季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 7 月 20 日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华西证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 7 月 28 日
鹏华基金管理有限公司关于深圳腾元基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 8 月 1 日
鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 8 月 7 日
鹏华基金管理有限公司关于北京增财基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 8 月 11 日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 8 月 23 日
2017 年半年度报告摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 8 月 28 日
鹏华基金管理有限公司关于泛华普益基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 9 月 1 日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 9 月 8 日

鹏华丰信分级债券型证券投资基金 2017 年开放申购与赎回业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 10 月 12 日
鹏华丰信分级债券型证券投资基金之丰信 A 和丰信 B 份额折算方案的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 10 月 17 日
关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金之丰信 A 开放日后约定年收益率的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 10 月 18 日
鹏华丰信分级债券型证券投资基金开通转换转出业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 10 月 19 日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017 年 10 月 20 日

上述披露事项的披露期间自 2017 年 4 月 22 日至 2017 年 10 月 21 日止。

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

（一）备查文件包括：

1. 中国证监会核准鹏华丰信分级债券型证券投资基金募集的文件

2. 《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》

3. 《鹏华丰信分级债券型证券投资基金托管协议》

4. 法律意见书

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照

7.中国证监会要求的其他文件

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1.存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处 ；其余备查文件存放在基金管理人处。

2.查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

鹏华基金管理有限公

司

2017 年 12 月