中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）
更新招募说明书

（2018 年第 1 号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

二〇一八年一月

重要提示

本基金经 2010 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧增强回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1316 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2010 年 12 月 2 日正式生效。

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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

根据相关法律法规的规定及本基金《基金合同》的约定，基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，决定自　　年　　月　日起对本基金增加　类份额并相应修改基金合同。

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，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书所载内容截止日 2017 年 12 月 1 日(特别事项注明除外)，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分 绪言

第二部分 释义

第三部分 基金管理人

第四部分 基金托管人

第五部分 相关服务机构

第六部分 基金的募集

第七部分 基金合同的生效

第八部分 基金的上市交易

第九部分 基金份额的场外申购、转换与赎回

第十部分 基金份额的场内申购与赎回

第十一部分 基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

第十二部分 基金的投资

第十三部分 基金的业绩

第十四部分 基金的财产

第十五部分 基金资产的估值

第十六部分 基金的收益分配

第十七部分 基金的费用与税收

第十八部分 基金的会计与审计

第十九部分 基金运作方式的转换及相关事宜

第二十部分 基金的信息披露

第二十一部分 风险揭示

第二十二部分 基金的终止与清算

第二十三部分 基金合同的内容摘要

第二十四部分 基金托管协议的内容摘要

第二十五部分 对基金份额持有人的服务

第二十六部分 其他应披露事项

第二十七部分 招募说明书的存放及查阅方式

第二十八部分 备查文件

附件一 基金合同内容摘要

附件二 基金托管协议内容摘要

第一部分　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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）等有关法律法规及《中欧增强回报债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)（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全部必要事项，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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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。

第二部分　释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1．基金或本基金：指中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）

2．基金管理人：指中欧基金管理有限公司

3．基金托管人：指广发银行股份有限公司

4．基金合同或本基金合同：指《中欧增强回报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《中欧增强回报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《中欧增强回报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《中欧增强回报债券型证券投资基金份额发售公告》

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，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

10.《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

11.《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12.《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

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：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

20．基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，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

22．场外：指通过深圳证券交易所开放式基金交易系统以外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所

23．场内：指通过深圳证券交易所会员单位并利用深圳证券交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所

24．直销机构：指中欧基金管理有限公司

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

26．销售机构：指直销机构、代销机构以及具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的会员单位，其中场外销售机构指直销机构和代销机构

27．注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

28．注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金注册登记机构为中

国证券登记结算有限责任公司和/或中欧基金管理有限公司

29．注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和/或中欧基金管理有限公司基金注册登记系统

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

31．基金账户：指注册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

32．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本基金的基金份额变动及结余情况的账户

33.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

34．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

35．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

36．存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37．工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38．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工作日

39．T＋n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

40．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

41．封闭期：指根据本基金合同中关于基金运作方式的约定，对本基金采取封闭式运作的期间，在该期间内基金份额保持不变，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金

42．交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43.《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《中欧基金管理有限公司开放式基金业

务规则》等相关业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

44．认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

45．申购：指基金转为上市开放式基金后，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

46．赎回：指基金转为上市开放式基金后，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

47．基金份额类别：指本基金根据注册登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

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、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

49．系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

50．跨系统转登记：指基金份额持有人将持有的基金份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为

51．定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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

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

53．元：指人民币元

54．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

55．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

56．基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57．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

58．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

59．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

60．不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法避免、无法克服且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

第三部分　基金管理人

一、基金管理人概况

1、名称：中欧基金管理有限公司

2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层、上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

4、法定代表人：窦玉明

5、组织形式：有限责任公司

6、设立日期：2006 年 7 月 19 日

7、批准设立机关：中国证监会

8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号

9、存续期间：持续经营

10、电话：021-68609600

11、传真：021-33830351

12、联系人：袁维

13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

14、注册资本：1.88 亿元人民币

15、股权结构：

序号	股东名称	出资额 （万元）	出资比例
1	意大利意联银行股份合作公司	4700	25%
2	国都证券股份有限公司	3760	20%
3	北京百骏投资有限公司	3760	20%
4	万盛基业投资有限责任公司	620.4	3.30%
5	上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）	3760	20%
6	窦玉明	940	5%
7	周玉雄	280.59	1.4925%
8	卢纯青	140	0.7447%

9	于洁	140	0.7447%
10	赵国英	140	0.7447%
11	方伊	100	0.5319%
12	关子阳	100	0.5319%
13	卞玺云	79.01	0.4203%
14	魏博	75	0.3989%
15	郑苏丹	75	0.3989%
16	曲径	75	0.3989%
17	黎忆海	55	0.2926%
	合计	18,800	100%

二、主要人员情况

．基金管理人董事会成员

窦玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学　　，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事，天合光能有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco D’Este **先生**，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（　　）国际部总监，联合信贷银行（　　）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（　　）机构银行业务部总监，并曾在　　（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处

长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson**先生**，英国籍。现任　　（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会 资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，中国籍。现任北京大学法学院教授、博士生导师，中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士、应用经济学博士后，德国洪堡学者，中国银行法学研究会副会长。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授等，毕业于北京大学、美国南美以美大学、哈佛大学法学院。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学　　学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

．基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州
律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士，监事，现任中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，监事，现任中欧基金管理有限公司理财规划总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

．基金管理人高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16 年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、策略组负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12 年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，16 年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，10 年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

．本基金基金经理

（1）现任基金经理

姓名	朱晨杰	性别	男
国籍	中国	毕业院校及专业	法国北方高等商业学校金融市场专业
其他公司历任	法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券融资部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员		
本公司历任	中欧基金管理有限公司投资经理		
本公司现任	基金经理		
本基金经理所管理	产品名称	起任日期	离任日期

基金具体情况			
1	中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
2	中欧强利债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
3	中欧强裕债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
4	中欧强泽债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
5	中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
6	中欧强盈定期开放债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
7	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
8	中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
9	中欧骏盈货币市场基金	2017 年 05 月 03 日	
10	中欧兴利债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	
11	中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）	2017 年 04 月 07 日	

12	中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）	2017 年 04 月 07 日	
13	中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）	2017 年 04 月 07 日	
14	中欧稳健收益债券型证券投资基金	2017 年 04 月 07 日	

（2）历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
刘德元	2015 年 08 月 20 日	2017 年 06 月 27 日
赵小强	2015 年 07 月 13 日	2015 年 08 月 20 日
袁争光	2014 年 05 月 07 日	2015 年 07 月 13 日
赖海英	2011 年 07 月 28 日	2012 年 06 月 13 日
聂曙光	2010 年 12 月 02 日	2014 年 05 月 07 日

．基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、副总经理顾伟、副总经理兼策略组负责人卢纯青、信用评估部负责人张明、策略组负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、黄华、周玉雄、赵国英、曲径、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

．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．基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）依据本基金合同的约定，转换本基金运作方式；

（9）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（10）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（11）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（12）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；

（13）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（14）依法召集基金份额持有人大会；

（15）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2．基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

（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、勤勉尽责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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）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；

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）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；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

（15）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；

（16）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；

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）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；

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

（20）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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人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托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）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；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规和基金合同规定的其他义务。

四、基金管理人承诺

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

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

（1）将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）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3．基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

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

5．基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、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．不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

3．不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4．不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的内部控制制度

1．内部控制的原则

（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．内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

（3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履 行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

（4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

（5）风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

（6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项的检查和反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

（7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

3．内部控制的措施

（1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业

务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

4．基金管理人关于内部合规控制声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

成立时间：1988 年 7 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154 亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363 号

联系人：周小磊

联系电话：（010）65169562

广发银行股份有限公司成立于 1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本 154 亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

截至 2016 年 12 月 31 日，广发银行总资产 20475.92 亿元、总负债 19416.18 亿元、实现营业收入 553.18 亿元、拨备前利润 364.43 亿元。据英国《银行家》杂志 2016 年全球银行排名，广发银行按一级资本列第 86 位。

（二）主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行处、内控与综合管理处、保险与期货业务处和客户营销处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作十八年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全

球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015 年 1 月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理，现主持部门工作。

（三）基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于 2009 年 5 月 4 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号。截至 2016 年 12 月末，托管资产规模 20,429.55 亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII 托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面的托管服务。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，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。

（二）内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专设内控与综合管理处，配备了专职内部监察稽核人员，负责托管业务的内部控制和风险管理工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

（三）内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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，基金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。

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用资产托管业务基金监督系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1、每工作日按时通过基金监督系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

第五部分　相关服务机构

一、场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)

二、场外发售机构

（一）A 类份额销售机构

．直销机构（　类）

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：窦玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

．代销机构（　类）

1)　名称：招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站：www.cmbchina.com

2)　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

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66215533

传真：010-66218888

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

3） 名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 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：杨娟

电话：010-68858076

传真：010-68858057

客服热线： 95580

网址：www.psbc.com

4） 名称：兴业银行股份有限公司

住所：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021-52629999-218966

客服热线：95561

网址：www.cib.com.cn

5） 名称：中国民生银行股份有限公司

住所：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：董文标

联系人：穆婷

电话：010-57092845

传真：010-57092611

客服热线：95568

网站：www.cmbc.com.cn

6） 名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：王媛

电话：010-65556689

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

7） 名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010- 63636388

传真：010- 63636713

客服热线：95595

网址：www.cebbank.com

8） 名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：潘逸

电话：020-38322888

传真：020-87310779

客服热线：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

9） 名称：国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

10）名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

11）名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

12）名称：广发证券股份有限公司

住所:广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

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

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87550265

传真：020-87553600

网址：www.gf.com.cn

13) 名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

14) 名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址:福建省福州市湖东路 268 号;上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20-22 层

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：0591-38507869

传真：0591-38507538

客服热线：95562c

网址：www.xyzq.com.cn

15) 名称：光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

16）名称：华福证券有限责任公司

住所：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-96326

传真：010-88085195、010-88085265-8191

客服热线：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

17）名称：中国银河证券股份有限公司

住所：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

电话：010-66568062

传真：010-66568704、010-66568532、010-66568640

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

18）名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 66 号

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

电话：021-20315255

传真：021-20315137

客服热线：95538

网址：http://www.zts.com.cn

19）名称：申万宏源证券有限公司

住所：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：储晓明

联系人：黄莹

电话：4008895523

传真：021-33388224

客服热线：95523

网址：www.swhysc.com

20）名称：申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

21）名称：海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：王立群

电话：021-23219000

传真：021-63410707、021-63410627

客服热线：95553

网址：www.htsec.com

22）名称：国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法人代表：蔡咏

联系人：李飞

电话：0551-62207323

传真：021-38670767

客服热线：95578、400-888-8777

网址：www.gyzq.com.cn

23）名称：平安证券股份有限公司

住所：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：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

24）名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676798

传真：021-38670798

客服热线：95521

网址：www.gtja.com

25）名称：安信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人：牛冠兴

联系人：张晨

电话：021-66581727

传真：010-66581721

客服热线：4008-001-001

网址：www.essences.com.cn

26）名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

传真：010-63081173

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

27）名称：华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

28) 名称：德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616-8259

传真：021-68761616

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

29) 名称：英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：李欣

电话：0755-83007179

传真：0755-83007167

客服热线：4008-698-698

网址：www.ydsc.com.cn

30) 名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383

传真：010-60836031；0755-23835525

客服热线：95558

网址：www.citics.com

31）名称：中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022313

传真：0532-85022301

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

32）名称：中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

联系人：洪城

电话：0755-23953913

客户热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

33）名称：爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：王薇

电话：021-32229888

传真：010-60836221

客服热线：021-63340678

网址：www.ajzq.com

34）名称：金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025500

传真：0755-83025625

客服热线：4008-888-228

网址： www.jyzq.cn

35）名称：西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服热线：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

36）名称：联讯证券有限责任公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

联系人：宋航

电话：0752-2119391

传真：0931-4890628

网址：www.lxzq.com.cn

37）名称：华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

38）名称：华融证券股份有限公司

住所：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 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人： 李慧灵

电话：010-85556100

传真：010- 85556153

客服热线：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

39）名称：民族证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法人代表人：赵大建

联系人：李微

电话：400-889-5618

传真：010-66553216

客服热线：400-889-5618

网址：www.e5618.com

40）名称：东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人： 方晓丹

电话：0512-62601555

传真：0512-62938812

客服热线：400-860-1555

网址：www.dwzq.com.cn

41）名称：中国国际金融股份有限公司

住所：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：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679535

客服热线：4009101166

公司网站：www.cicc.com.cn

42）名称：方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22－24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22－24 层

法定代表人：高利

联系人：高洋

电话：010-59355546

传真：010-56437013

客服热线：95571

公司网站：

43）名称：天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：010-66045152

传真：010-66045518

客服热线：010-66045678

网址：www.txsec.com 、www.jjm.com.cn

44）名称：深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

众禄基金销售网：www.zlfund.cn

基金买卖网：www.jjmmw.com

45）名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

46）名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-58788678

传真：021-58787698

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

47）名称：和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

48）名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

49）名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐昳绯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

50）名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层

法定代表人：其实

联系人：李广宇

电话：021-54509977-8400

传真：021-54509953

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

51）名称：浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：汪林林

电话：0571-88920810

传真：0571-86800423

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

52）名称：北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366

传真：010-62020355

客服热线：400-818-8000

网址：www.myfp.cn

53）名称：上海陆金所资产管理有限公司

住所：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：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户热线： 400-821-9031

网址：www.lufunds.com

54) 名称：上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-33323837

客户热线： 400-821-3999

网址：https://tty.chinapnr.com

55) 名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

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

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

56) 名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

57）名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服热线：4000-618-518

网址：https://danjuanapp.com

58）名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/ 4000888816

网址：http://fund.jd.com/

59）名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：

60) 名称：上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（二） E 类份额销售机构

．直销机构（ 类）

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：窦玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

．代销机构（ 类）

1） 名称：广东南海农村商业银行股份有限公司

住所：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

办公地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

法定代表人：李宜心

联系人：吴泳施

电话：0757-86369512

传真:：0757-86250627

客服热线:：96138

网址：www.nanhaibank.com

2） 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：刘信义

联系人：唐苑

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客服热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

3） 名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 66 号

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

电话：021-20315255

传真：021-20315137

客服热线：95538

网址：http://www.zts.com.cn

4） 名称：平安证券股份有限公司

住所：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：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

5） 名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

6） 名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

7） 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐昳绯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

8） 名称：上海陆金所资产管理有限公司

住所：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：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户热线： 400-821-9031

网址：www.lufunds.com

9） 名称：上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-33323837

客户热线： 400-821-3999

网址：https://tty.chinapnr.com

10）名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

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

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

11）名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

12）名称：上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：徐鹏

电话：021-50583533

传真：021-50583633

客服热线：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

13）名称：上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

14）名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服热线：4000-618-518

网址：https://danjuanapp.com

15）名称：天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287984

传真：010-59287825

客服热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

16）名称：北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

联系人：王英俊

电话：13911468997

传真：010-92055860

客服热线：400-623-6060

网址：www.niuiufund.com

17）名称：上海万得投资顾问有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服热线；400-821-0203

网址：暂无

18）名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

电话：010-62676405

传真：010-62676582

客服热线；010-62675369

网址：www.xincai.com

19）名称：上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层,200127

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

电话：021-20538888

传真：021-20539999

客服热线：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

20）名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/ 4000888816

网址：http://fund.jd.com/

21）名称：上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-88066552

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

22）名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：www.hcjijin.com

23）名称：上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

三、注册登记机构

本基金 A 类份额注册登记机构信息如下：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人： 周明

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938828

本基金 E 类份额注册登记机构信息如下：

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：窦玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

四、出具法律意见书的律师事务所

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：吕红 安冬

电话：021－31358666

传真：021－31358600

联系人：吕红

五、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

本基金于 2017 年 12 月 30 日发布公告《中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告》，改聘本基金的会计师事务所，改聘前会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），改聘后会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。特此说明。

第六部分　基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2010 年 10 月 8 日证监许可[2010]1361 号文核准募集发售。募集期为 2010 年 11 月 1 日至 2010 年 11 月 26 日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 2,374,288,996.67 份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为 17,590 户。

第七部分　基金合同的生效

一、基金合同生效

本基金基金合同于 2010 年 12 月 2 日正式生效。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

三、基金份额的类别

本基金根据注册登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；E 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司。

本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额分别设置代码。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值＝该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。

第八部分　基金的上市交易

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的 A 类基金份额上市交易。本基金 A 类基金份额上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金 A 类份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。本基金 E 类基金份额不在交易所上市交易。

一、上市交易的地点

深圳证券交易所。

二、上市交易的时间

本基金A类基金份额已于2011年2月18日开始在深圳证券交易所上市交易。

三、上市交易的规则

本基金 A 类基金份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

四、上市交易的费用

本基金 A 类基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

五、上市交易的行情揭示

本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日 A 类基金份额的基金份额净值。

六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

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

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

第九部分　基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于本基金 A 类份额和 E 类份额的场外申购和赎回业务。

一、场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务：

1．本基金管理人的直销网点。

2．不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类份额变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

二、场外申购与赎回的开放日及办理时间

1．本基金合同生效后一年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易。在封闭期内，投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所交易基金份额。

基金合同生效满一年后，转为上市开放式基金（LOF），投资人方可申购、赎回基金份额。转换运作方式后，基金份额（新增 E 份额后对应的 A 类基金份额）仍将在深圳证券交易所上市交易。

基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的 3 个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2．申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理该类基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3. 若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在

至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（注：本基金于 2011 年 12 月 2 日开始办理日常申购、赎回业务。）

三、场外申购与赎回的原则

1.“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类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．赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回；

4.“全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

5．当日的申购与赎回申请可以在当日的交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

四、场外申购与赎回的程序

1．申购和赎回的申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。

2．申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），正常情况下，本基金注册登记机构在 T＋1 日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后（包括该日）投资人可向销售网点或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3．申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人，该退回款项产生的利息等损失

由投资人自行承担。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。赎回申请成功后，基金管理人在 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，赎回的处理办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

五、场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后，注册登记机构在 T＋1 日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T＋2 日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T＋1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

六、场外申购与赎回的限制

1．申购金额的限制

场外申购时，其他销售机构的销售网点每个账户单笔申购本基金 A 类份额的最低金额为 1 元人民币。其他销售机构的销售网点每个账户单笔申购本基金 E 类份额的最低金额为 10.00 元，追加申购单笔最低金额为 0.01 元。

直销机构每个账户首次申购的最低金额为 10,000 元人民币，追加申购单笔最低金额为 10,000 元人民币（通过本公司网上交易系统申购本基金暂不受此限制，其 A 类基金份额的申购最低金额为单笔 10 元，其 E 类基金份额的单笔申购最低金额为 10.00 元，追加申购单笔最低金额为 0.01 元）。

2．赎回份额的限制

场外赎回时，赎回本基金 A 类份额的最低份额为 0.01 份基金份额；基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个基金账户的该类基金份额余额少于 0.01 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

基金份额持有人在销售机构赎回本基金　类份额时，每次对本基金　类份额的赎回申请不得低于　　份基金份额。本基金　类份额的最低保留份额为

份。

3．基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

投资者可多次申购，对单个投资人的累计持有份额不设上限限制，本招募说明书另有约定的除外。

七、场外申购费用和赎回费用

1．申购费用

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

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。

养老金客户包括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，具体包括：

（1）全国社会保障基金；

（2）可以投资基金的地方社会保障基金；

（3）企业年金单一计划以及集合计划；

（4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；

（5）企业年金养老金产品。

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中心申购本基金的养老金客户申购费率见下表：

单笔金额（M）	收费标准
M＜50 万元	0.24%
50 万元≤M＜100 万元	0.15%
100 万元≤M＜500 万元	0.09%
M≥500 万元	每笔 1000 元

其他投资人场外申购本基金的申购费率见下表：

单笔金额（M）	收费标准
M＜50 万元	0.80%
50 万元≤M＜100 万元	0.50%
100 万元≤M＜500 万元	0.30%
M≥500 万元	每笔 1000 元

2．赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，不低于赎回费总额的 25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金场外赎回费率如下表：

持有基金份额期限（N）	收费标准
N＜1 年	0.10%
1 年≤N＜2 年	0.05%
N≥2 年	0

在场外认购、场外申购的投资人其份额持有年限以份额实际持有年限为准；在场内认购、场内申购以及场内买入，并转托管至场外赎回的投资人其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算。

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

八、场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

1．申购份额与赎回金额的处理方式：

（1）申购份额、余额的处理方式：场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以有效申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入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；

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入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。

2．本基金申购份额的计算：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。本基金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/T 日该类基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用＝固定金额

净申购金额 申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额 申购当日该类基金份额的基金份额净值

例：某投资人（非养老金客户）投资 40,000 元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 0.8%，假设申购当日该类基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额＝40,000 元

净申购金额＝40,000/(1＋0.8%)＝39,682.54 元

申购费用＝40,000－39,682.54＝317.46 元

申购份额＝(40,000－317.46)/1.0400＝38,156.29 份

即：某投资人（非养老金客户）投资 40,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日该类基金份额净值为 1.0400 元，则可得到 38,156.29 份该类基金份额。

3．本基金赎回支付金额的计算：

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额＝T 日申请份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

例：某投资人赎回 10,000 份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设

赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额＝10,000×1.0160＝10,160 元

赎回费用 ＝10,160×0.10%＝10.16 元

赎回金额 ＝10,160－10.16＝10,149.84 元

即：投资人赎回本基金 A 类基金份额 10,000 份，假设赎回当日该类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,149.84 元。

4．基金份额净值的计算公式为：

某类基金份额净值＝计算日该类基金资产净值总额/计算日发行在外的该类基金份额总数。

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

T 日的基金份额净值在当日收市后计算并在次日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

1．因不可抗力导致基金无法正常运作。

2．证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3．发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4．基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5．基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

7．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人

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

十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。此时，本基金的转出申请将按同样方式处理：

1．因不可抗力导致基金无法正常运作。

2．证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3．连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4．发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分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开放日予以支付，但最长不超过 20 个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1．巨额赎回的认定

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

2．巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认

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

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

3．巨额赎回的公告

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

十二、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 个开放日的各类基金份额的基金份额净值。

3．如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日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 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。

4．如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日各

类基金份额的基金份额净值。

十三、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、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、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在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十五、基金的冻结和解冻

基金注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第十部分　基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金 A 类份额通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

一、投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者，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者。

二、使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

三、场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单（有可能进行调整或变更）可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

四、申购与赎回的办理时间

1．本基金合同生效后一年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易。在封闭期内，投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所交易基金份额。

基金合同生效满一年后，转为上市开放式基金（LOF），投资人方可申购、赎回基金份额。转换运作方式后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的 3 个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2．申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格

为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3．若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（注：本基金于 2011 年 12 月 2 日开始办理日常申购、赎回业务。）

五、场内申购和赎回的原则

1.“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类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.“全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

4．当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

六、场内申购和赎回的程序

1．申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金 A 类份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够基金 A 类基金份额余额，否则赎回申请无效。

2．申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T＋1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资人可在 T＋2 日到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。

申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3．申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若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。

投资人赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。

关于“巨额赎回的认定”和“巨额赎回的公告”参照第九章相关内容规定。

七、场内申购和赎回的数额限制

1．单笔场内申购的最低金额为 1,000 元，同时申购金额必须是整数金额。

2．基金管理人可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。如调整上述限制的，基金管理人必须在调整 3 个工作日前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

3．申购份额、余额的处理方式：本基金的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。

4．赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

投资者可多次申购，对单个投资人的累计持有份额不设上限限制，本招募说明书另有约定的除外。

八、申购费用和赎回费用

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

本基金 A 类份额的场内申购费率如下表：

单笔金额（M）	收费标准
M＜50 万元	0.80%
50 万元≤M＜100 万元	0.50%

100 万元≤M＜500 万元	0.30%
M≥500 万元	每笔 1000 元

2．投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，不低于赎回费总额的 25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内赎回费率为固定值 0.1%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

3．基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人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》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

九、场内申购份额和赎回金额的计算方式

1．基金申购份额的计算

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购手续费＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资 10,000 元申购本基金 A 类份额，对应的申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.0250 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额＝10,000/（1＋0.8%）＝9,920.63 元

申购手续费＝10,000－9,920.63＝79.37 元

申购份额＝9,920.63/1.0250＝9,678.66 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9,678 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

实际净申购金额＝9,678×1.0250＝9,919.95 元

退款金额＝10,000－9,919.95－79.37＝0.68 元

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金 A 类份额，假设申购当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得到基金 A 类份额 9,678 份，退款 0.68 元。

2．基金赎回金额的计算

赎回总金额＝T 日赎回份额×T 日 A 类基金份额净值

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

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人从深交所场内赎回本基金 A 类基金份额 10,000 份，赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值为 1.1480 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额＝10,000×1.1480＝11,480 元

赎回费用＝11,480×0.1%＝11.48 元

净赎回金额＝11,480－11.48＝11,468.52 元

即：投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,468.52 元。

3．T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在次日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

4．基金份额净值的计算公式

A 类基金份额净值＝计算日 A 类基金资产净值/计算日发行在外的 A 类基金份额总数

十、场内申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

十一、办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

十二、有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第九章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

第十一部分　基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

一、基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

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；捐赠指受理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注册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注册登记机构规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

二、基金份额的登记

1.本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2．登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接申请场内赎回，也可上市交易。登记在证券登记结算系统中的基金份额如需办理场外赎回，应当办理跨系统转登记后方能实施。

3．登记在注册登记系统中的基金份额可直接申请场外赎回。登记在注册登记系统中的 A 类基金份额如需办理场内赎回或上市交易，应当办理跨系统转登记后方能实施。

三、系统内转托管

1．系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2．基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。

3．基金份额登记在证券登记结算系统的 A 类基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

四、跨系统转登记

1．跨系统转登记是指持有人将持有的 A 类基金份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2．本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。场外 A 类基金份额的基金份额持有人可通过跨系统转登记业务将场外 A 类基金份额转登记到场内后进行上市交易，E 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。

第十二部分　基金的投资

一、投资目标

在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。

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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，但可以参与新股申购、股票增发，并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%。

本基金投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产比例合计不低于 40%。本基金所指信用债券是指金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债券、可转债、可分离交易可转债、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

在封闭期结束后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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

三、投资策略

1．资产配置策略

本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响债券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、债券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。

本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调

整固定收益类资产投资比例。

2．固定收益类资产投资策略

（1）利率策略

① 久期管理策略

由于久期反映了利率变化对债券价格的影响程度，因此本基金将根据对宏观经济趋势和利率走势的预判，对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

② 收益率曲线策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化，并相应选择子弹型、哑铃型或梯形策略，以获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

③ 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获得价差收益。

④ 息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于中长期债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

（2）信用策略

本基金力争通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在信用债券的选择时特别重视信用风险的评估和防范。本基金通过分析宏观经济趋势和信用风险历史情况，判断当前信用债券市场整体的信用风险水平，从而确定信用债券整体投资比例。本基金根据信用债券发行人的行业前景、行业地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价信用债券发行人的信用风险，同时根据信用债券的特别条款,评估信用债券的信用风险。

（3）可转债投资策略

本基金将结合可转债发行公司的基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、基本面良好、定价偏低的公司的可转债进行投资。本基金还基于对利率走势、到期收益率、可转债特别条款、发行公司信用风险、个券流动性等因素，分析可转债的债券投资价值。同时，采用期权定价模型，估算可转债的转换期权价值。综合以上因素，对可转债进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

（4）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指将缺乏流动性但可预测未来现金流的资产组成资产池并以资产池所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

（5）流动性策略

本基金还将根据个券发行总量、流通量、上市时间、交易量等流动性指标，决定该个券投资总量的上限。

3．非固定收益类资产投资策略

（1）新股申购策略

本基金的新股申购策略包括新股发行和股票增发的申购策略。在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定差价，从而使新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金同时也认为，该差价是暂时现象，新股申购策略是一种阶段性投资策略。

本基金将结合公司基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、公司基本面良好、定价偏低的个股进行申购，规避质量较差的公司。

本基金还综合考虑新股中签率、上市首日涨幅、锁定期限内股价表现和市场资金供求关系等因素，选择网上申购或网下申购及申购数量。所中签的新股在上市交易后择机卖出。

（2）权证投资策略

本基金不主动投资权证但可持有因持有股票或可分离债而获得的权证。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行持有并择机卖出。

四、投资决策

1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资策略组负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和基金运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，对基金投资的重大问题进行决策，并在必要时做出修改。

投资策略组负责人负责本策略组内投资管理和 些