

九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置  
混合型证券投资基金  
招募说明书更新

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

---

---

**【重要提示】**

本基金的募集申请经中国证监会 2016 年 6 月 27 日证监许可【2016】1438 号文注册。本基金的基金合同已于 2016 年 8 月 30 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，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，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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，投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等（详见本招募说明书的“风险揭示”部分）。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放运作方式。基金合同生效后，基金份额将申请在深圳证券交易所上市与交易。在场内交易过程中，可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

在本基金在封闭期内以及转为上市开放式基金（LOF）后，基金投资有明确锁定期的非公开发行股票时，按照监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值。投资者在二级市场交易或申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于

---

---

中高风险收益特征的证券投资基金品种。本基金可投资资产支持证券、中小企业私募债券、股指期货和权证等金融衍生品，可能给本基金带来额外风险。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新基金业绩表现的保证。

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。

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2月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日（财务数据未经审计）。

---

---

## 目 录

第一部分	前言	1
第二部分	释义	2
第三部分	基金管理人	8
第四部分	基金托管人	19
第五部分	相关服务机构	24
第六部分	基金的募集与基金合同的生效	41
第七部分	基金份额的上市交易	42
第八部分	基金份额的运作方式、申购与赎回	44
第九部分	基金的投资	57
第十部分	基金的业绩	72
第十一部分	基金的财产	73
第十二部分	基金资产估值	74
第十三部分	基金的收益与分配	79
第十四部分	基金费用与税收	81
第十五部分	基金的会计与审计	83
第十六部分	基金份额转换	84
第十七部分	基金的信息披露	86
第十八部分	风险揭示	92
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	96
第二十部分	基金合同的内容摘要	98
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要	115
第二十二部分	对基金份额持有人的服务	136
第二十三部分	其他应披露事项	138
第二十四部分	招募说明书的存放及查阅方式	140
第二十五部分	备查文件	141

---

---

## 第一部分 前言

《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“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》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合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九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、投资策略、投资风险、费率结构等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由九泰基金管理有限公司解释。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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 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：指九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2、基金管理人：指九泰基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司

4、基金合同：指《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对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《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合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，并经 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做出的修订

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

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

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施

的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《上市交易公告书》：指《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、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

16、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

17、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

18、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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指符合《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

22、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者

23、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，办理基金份额的认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指九泰基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

25、会员单位：指具有基金销售业务资格，经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深圳证券交易所会员单位

26、场外：通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

27、场内：通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

28、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者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

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

30、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，登记在该系统的基金份额也称为场外份额

31、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，登记在该系统的基金份额也称为场内份额

32、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记系统

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

34、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、交易、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及



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者申购、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、定期开放：指本基金采取的在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式

43、封闭期：本基金首个封闭期为自基金合同生效日起至两年后的年度对日前的倒数第一个工作日之间的期间；第二个封闭期为第一个开放期结束之日次日至第二个封闭期起始之日起两年后的年度对日前的倒数第一个工作日之间的期间，以此类推。本基金共有三个封闭期，本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，场内份额可以在满足上市交易条件后在深交所上市交易

44、开放期：指本基金两个封闭期之间开放申购、赎回等业务的期间。本基金自每个封闭期结束之后进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务

本基金每两年开放一次，每个封闭期起始之日起两年后的年度对日的第一个工作日（包括该日）进入开放期，本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，期间可以办理申购与赎回业务。

45、开放日：指销售机构办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

46、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

47、年度对日：指某一特定日期在后续年度中的对应日期，若该日历年中不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日

48、《业务规则》：指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订

49、认购：指在基金募集期内，投资者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

50、申购：指基金合同生效后，投资者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

51、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

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

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

54、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

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

56、跨系统转托管：指投资者将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

57、基金份额转换：本基金自第三个封闭期结束起，按照基金合同规定的份额转换规则，九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金份额在转换日自动转换为上市开放式基金（LOF）份额

58、基金份额转换日：本基金第三个封闭期结束后第一个工作日

59、定期定额投资计划：指投资者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者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

60、巨额赎回：指本基金开放期内的单个开放日和本基金转为上市开放式基金（LOF）后的前五个开放日，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 20%; 本基金转为上市开放式基金 (LOF) 五个开放日后, 单个开放日的基金净赎回申请 (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%

61、元: 指人民币元

62、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

63、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

64、基金资产净值: 指基金资产总值减去基金负债后的价值

65、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

66、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

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

68、不可抗力: 指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人的基本情况

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园8号楼A栋

成立日期：2014年7月3日

法定代表人：卢伟忠

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期限：2014年7月3日至长期

联系电话：010-57383999

联系人：韩炳光

股权结构：昆吾九鼎投资管理有限公司、同创九鼎投资管理集团股份有限公司、拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司、九州证券股份有限公司出资分别占注册资本的26%、25%、25%和24%的股权。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

吴强先生，管理学硕士，董事长。曾任万联证券投行部业务经理，宏源证券资本市场部副总经理，安信证券投行部业务副总裁，国信证券投行部总经理助理。现任九州证券股份有限公司董事长，九泰基金管理有限公司董事长。

吴刚先生，管理学硕士，董事。曾任闽发证券投资银行部项目经理，中国证监会机构监管部副处长、处长。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事长。

卢伟忠先生，金融学硕士，董事、法定代表人，总经理。曾任金瑞期货研究员，安信证券股指期货IB业务专员，安信期货办公室主任，安信期货IB业务部总经理，安信证券资产管理部产品总监，安信乾盛常务副总经理。现任九泰基金管理有限公司董事、法定代表人，总经理。

袁小文女士，高级管理人员工商管理硕士，独立董事。曾任广东万通期货公司副总经理，浙江金马期货公司常务副总，长城伟业期货经纪有限公司（后更名为华泰长城期货有限公司）副总经理，华泰长城期货有限公司总经理，中信证券股份有限公司下属子公司执行副董事长，中信期货有限公司董事长，现任阳富教育咨询服务（深圳）有限公司董事长职务。

徐艳女士，经济学博士，独立董事。曾任长春税务学院金融系国际金融教研室主任，海国投工业开发股份有限公司投资部经理，现任海南大学 MBA 教育中心主任职务，院学位委员会委员、院学术委员会委员等职务。

陈耿先生，经济学博士，教授，独立董事。曾任青岛崂山区政府（高科技开发区）职员，重庆大学工商管理博士后科研站博士后，重庆大学经济与工商管理学院教师，现任重庆大学经济与工商管理学院 EMBA 中心主任职务。

## 2、监事会成员

徐磊磊先生，工商管理硕士，监事。曾任昆吾九鼎投资管理有限公司行政助理、行政经理，同创九鼎投资管理集团股份有限公司监事，现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司证券事务代表。

刘开运先生，金融学硕士，监事。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。现任九泰基金管理有限公司战略投资部定增业务组（锐系列）执行投资总监。

## 3、公司高级管理人员

卢伟忠先生，简历同上。

王玉女士，涉外经济本科，副总经理。曾任陕西群力子弟学校教师，北京思拓克斯商贸有限公司经理助理，太平洋人寿保险北京分公司营销业务部经理、海淀支公司总经理、分公司党委委员、副总经理，国风共创管理咨询有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

吴祖尧先生，工学硕士，副总经理。曾任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

陈沛先生，法学硕士，督察长。曾任广州大学松田学院教师、平安证券有限

责任公司合规专员、安信证券股份有限公司董事会办公室股权管理专员、安信基金管理有限责任公司监察稽核部法律主管、泰达宏利基金管理有限公司监察稽核部负责人。现任九泰基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

刘开运先生，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，7年证券从业经验。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。2014年7月加入九泰基金管理有限公司，现任战略投资部定增投资中心总经理、锐系列定增业务组执行投资总监，九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年7月16日至2016年7月16日）、九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金（2015年8月14日至今）、九泰锐富事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（2016年2月4日至今）、九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年8月11日至今）、九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（2016年8月30日至今）、九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年12月19日至今）、九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金（2017年3月24日至今）的基金经理。

#### 5、公募投资决策委员会成员

本公司公募投资决策委员会成员包括：吴祖尧先生（委员会主席）、张勇先生、刘开运先生、刘心任先生。

吴祖尧先生，同上。

张勇先生，经济学硕士，基金经理。15年证券从业经验，历任南京市商业银行信贷员、债券交易员，博时基金管理有限公司债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、固定收益总部现金管理组投资总监、博时现金收益证券投资基金基金经理（2006年7月至2015年5月）、博时策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2009年8月至2015年5月）、博时稳定价值债券投资基金基金经理（2010年8月至2014年2月）、博时安盈债券型证券投资基金基金经理（2013年4月至2015年5月）、博时宏观回报债券型证券投资基金基金经理（2014年2月至2015年5月）、博时天天增利货币市场基金（2014年8月至2015年6月）基金经理、博时现金宝货币市场基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014年9月至2015年6月）

基金经理、博时保证金实时交易型货币市场基金（2014年11月至2015年6月）基金经理。现任九泰基金管理有限公司总裁助理兼绝对收益部总经理。

刘开运先生，同上。

刘心任先生，北京大学、香港大学经济金融双硕士，中国籍。7年证券从业经验，具有基金从业资格。曾任广发基金管理有限公司研究员。2015年5月加入九泰基金管理有限公司任研究发展部总监兼定增投资中心副总经理。现任九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016年11月15日至今）的基金经理。

6、公司董事长吴强先生与公司董事吴刚先生系兄弟关系。除此以外，上述人员之间无近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、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活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。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (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，不按照规定履行职责；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(9) 贬损同行，以抬高自己；

(10) 以不正当手段谋求业务发展；

(11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(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) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

#### 5、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、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(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体系

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、公司的内部控制目标

(1) 确保合法合规经营；

(2) 防范和化解风险；

(3) 提高经营效率；

(4) 保护基金份额持有人和股东的合法权益。

## 2、公司内部控制遵循的原则

### (1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

### (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，维护风险管理制度的有效执行。

### (3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

### (4) 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

### (5) 成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法，并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性，尽量降低经营成本，提高经营效益，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### (6) 适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

### (7) 内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

### (8) 防火墙原则

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司

会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

### 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

### 4、内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

(1) 建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

(2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部部门及岗位负有监督的责任；

(3) 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

### 5、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

#### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和

人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### （2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### （3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### （4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，

---

同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 6、基金管理人关于内部控制制度声明书

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

---

---

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人的基本情况

#### 1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### 2、主要人员情况

截至 2017 年末，中国工商银行资产托管部共有员工 230 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年末，中国工商银行共托管证券投资基金 815 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海

证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 二、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

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

### 2、内部风险控制组织结构

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



### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

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

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

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

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

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### 4、内部风险控制措施实施

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

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

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

与控制理念。

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

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

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

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部控制情况

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

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

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

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。

---

---

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

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

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

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

##### 1) 九泰基金管理有限公司北京直销中心

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋

法定代表人：卢伟忠

电话：010-57383818

传真：010-57383894

邮箱：service@jtamc.com

公司网址：<http://www.jtamc.com/>

联系人：潘任会

##### 2) 九泰基金管理有限公司电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：<http://www.jtamc.com/>

##### (2) 代销机构

##### 1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

公司网址：<http://www.icbc.com.cn/icbc/>

##### 2) 北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：400-818-8866

公司网址：<https://fund.shengshiview.com/>

3) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西路 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西路 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：95573

公司网址：<http://www.i618.com.cn/>

4) 大同证券有限责任公司

住所：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

客户服务电话：4007-121-212

公司网址：<https://www.dtsbc.com.cn/>

5) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区白泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：王岩

客户服务电话：400-819-9868

公司网址：<http://www.tdyhfund.com/>

6) 九州证券股份有限公司

住所：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：魏先锋

客户服务电话：95305

公司网址：<http://www.jzsec.com/>

7) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

客户服务电话：95511

公司网址：<http://stock.pingan.com/>

8) 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：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587/4008-888-108

公司网址：<https://www.csc108.com/>

9) 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 12-18 层

法定代表人：祝献忠

客户服务电话：95390/400-898-9999

公司网址：<http://www.hrsec.com.cn/>

10) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

客户服务电话：400-8888-993

公司网址：<http://www.dxzq.net/>

11) 恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

客户服务电话：400-196-6188

公司网址：<https://www.cnht.com.cn/>

12) 国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

---

---

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

公司网址：<http://www.gjq.com.cn/>

13) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

客户服务电话：400-100-3391

公司网址：<http://www.dianyingfund.com/>

14) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584/4008-888-818

公司网址：<http://www.hx168.com.cn/>

15) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

客户服务电话：0571-86655920

公司网址：<https://www.cd121.com/>

16) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

公司网址：<http://www.zts.com.cn/>

17) 深圳盈信基金销售有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1（811-812）

办公地址：大连市中山区南山 1910 小区 A3-1

法定代表人：苗宏升

客户服务电话：4007-903-688

公司网址：<http://www.fundying.com/>

18) 长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

客户服务电话：95579

公司网址：<https://www.95579.com/>

19) 济安财富（北京）资本管理有限公司

住所：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富 A 座 46 层

法定代表人：杨健

客户服务电话：400—673—7010

公司网址：<http://www.jianfortune.com/>

20) 民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 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 16-18 层

法定代表人：冯鹤年

客户服务电话：400-619-8888

公司网址：<http://www.msza.com/>

21) 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：吴坚

客户服务电话：95355 或 4008-096-096

公司网址：<http://www.swsc.com.cn/>



## 22) 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：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层（信达证券）

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95321

公司网址：<http://www.cindasc.com/>

## 23) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

客户服务电话：400-027-9899

公司网址：<http://www.buyfunds.cn/>

## 24) 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

客户服务电话：010-62675369

公司网址：<https://trade.xincai.com/>

## 25) 上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：浦东新区上丰路977号1幢B座812室

办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼

法定代表人：廖冰

客户服务电话：400-699-1888

公司网址：<http://www.998fund.com/>

## 26) 海银基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

客户服务电话：400-808-1016

公司网址：<http://www.fundhaiyin.com/>

27) 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

客户服务电话：400-820-2899

公司网址：<http://www.erichfund.com/>

28) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525

公司网址：<http://www.ebscn.com/>

29) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人：姜昧军

客户服务电话：4008323000

公司网址：<http://www.csco.com.cn/>

30) 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 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：400-061-8518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

## 31) 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

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 6 层

法定代表人：戴新装

客户服务电话：400-820-1515

公司网址：<http://www.zhengtongfunds.com/>

## 32) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

客户服务电话：400-918-0808

公司网址：<http://www.xds.com.cn/>

## 33) 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：曹怡晨

客服电话：400-921-7755

公司网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

## 34) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

客户服务电话：010-67000988

公司网址：<http://www.zcvc.com.cn/>

## 35) 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 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号

---

---

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

客户服务电话：400-8773-772

公司网址：<http://www.5ifund.com/>

36) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：王哲宇

客户服务电话：400-643-3389

公司网址：<https://www.vstonewealth.com/>

37) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇

客户服务电话：400-821-9031

公司网址：<https://www.lufunds.com/>

38) 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：金佶

联系人：陈云卉

客户服务电话：400-820-2819

公司网址：<http://www.chinapnr.com/>

39) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易区富特北路 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 楼

法定代表人：燕斌

---

联系人：兰敏

客户服务电话：400-166-6788

公司网址：<http://www.66liantai.com/>

40) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客户服务电话：400-166-1188

公司网址：<http://www.new-rand.cn/>

41) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

客服服务电话：400-893-6885

公司网址：<http://www.qianjing.com/>

42) 大泰金石投资管理有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

客户服务电话：400-928-2266

公司网址：<http://www.dtfunds.com/>

43) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

---

---

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<https://www.yilucaifu.com/>

44) 上海大智慧财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

联系人：胡旦

客户服务电话：021-20219931

公司网址：<http://www.gw.com.cn>

45) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：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：张裕

客户服务电话：400-821-5399

公司网址：<https://www.noah-fund.com/>

46) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：<https://www.ehowbuy.com/>

47) 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 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：<http://www.1234567.com.cn/>

48)湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：林俊波

联系人：李欣

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：<http://www.xcsc.com/>

49)珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

公司网址：<https://www.yingmi.cn/>

50)北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：胡伟

联系人：姜颖

客户服务电话：400-618-0707

公司网址：<https://www.hongdianfund.com/>

51)中证金牛（北京）投资咨询有限公司（金牛理财网）

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号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

---

联系人：孙雯

客户服务电话：400-890-9998

公司网址：<http://www.jnlc.com/>

52)深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人：刘鹏宇

联系人：杨涛

客户服务电话：0755-83999907

公司网址：<http://www.fujiwealth.cn/>

53)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：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：<http://www.hcjijin.com/>

54)和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

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：刘洋

客户服务电话：400-920-0022

公司网址：<http://www.hexun.com/>

55)深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平



客户服务电话：400-678-8887

公司网址：<https://www.zlfund.cn/>

56)深圳前海微众银行股份有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼

法定代表人：顾敏

联系人：罗曦

客服电话：400-999-8877

公司网址：<http://www.webank.com/>

57)北京肯特瑞财富管理有限公司

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：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：熊彦清

客户服务电话：400-098-8511

公司网址：<http://fund.jd.com>

58)上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路518号北美广场A1002室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客户服务电话：400-820-5369

公司网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

59)凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼

---

---

法定代表人：程刚

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：<http://www.fengfd.com/>

60) 上海万得基金销售有限公司

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：王延福

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-821-0203

网址：<https://www.520fund.com.cn/>

61) 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：毛淮平

联系人：仲秋玥

客服服务电话：400-817-5666

网址：<https://www.amcfortune.com/>

62) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：张得仙

客服服务电话：400-6099-200

网址：<http://www.yixinfund.com/>

63) 中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

---

客户服务电话：95329

网址：<http://www.zszq.com/>

2、场内销售机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位经深圳证券交易所确认后也可代理场内基金份额的发售。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

## 二、登记机构

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

电话：010-59378982

传真：010-58598907

联系人：程爽

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

联系人：李晗

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

负责人：曾顺福

联系人：杨婧

联系电话：021-61418888

传真电话：021-63350003

经办注册会计师：文启斯、杨丽

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

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募集，募集申请经中国证监会 2016 年 6 月 27 日证监许可【2016】1438 号文注册。

募集期从 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 8 月 23 日止，共募集 883,861,642.79 份基金份额（含利息结转份额 566,239.94 份），募集户数为 6,507 户。

本基金为混合型基金，存续期间为不定期。

### 二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2016 年 8 月 30 日正式生效。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金自基金合同生效后，在任一开放期的最后一个开放日日终，有下列情形之一的，基金管理人应当终止基金合同：

- 1、基金份额持有人数量不满200人的；
- 2、基金资产净值低于5000万元的。

由上述情形导致基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

自基金合同生效后第三个封闭期结束起，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第七部分 基金份额的上市交易

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

本基金自第三个封闭期结束起,按照基金合同约定转为上市开放式基金(LOF),并更名为九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF),转换后本基金继续在深圳证券交易所上市与交易。本基金在转为上市开放式基金(LOF)前后可根据情况暂停上市与交易,恢复时间以本基金管理人公告为准。

### 一、上市交易的地点

深圳证券交易所。

本基金份额上市后,登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司场内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注册登记系统中的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统后,方可上市交易。

### 二、上市交易的时间

2016年12月15日。

### 三、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定,包括但不限于:

- 1、基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值;
- 2、本基金基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值;
- 3、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日起实行;
- 4、本基金买入申报数量为100份或其整数倍;
- 5、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;
- 6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及相关规定。

### 四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### 五、上市交易的行情揭示

---

本基金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本基金前一交易日的基金份额净值。

#### 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》和深圳证券交易所的相关规定执行。管理人有权根据基金转换需求与交易所相关规定暂停交易或上市。

#### 七、其他事项

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并可以在本基金更新的招募说明书中列示。

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

## 第八部分 基金份额的运作方式、申购与赎回

### 一、基金份额的运作方式

本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。

本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效两年后的年度对日前的倒数第一个工作日。第一个封闭期结束之后的第一个工作日进入第一个开放期，本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，期间可以办理申购与赎回业务。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日两年后的年度对日前的倒数第一个工作日，第二个封闭期结束后的第一个工作日进入第二个开放期。举例说明，假设基金合同生效日为 2016 年 8 月 8 日，则第一个封闭期的结束日为 2018 年 8 月 7 日，假设本基金的第一个开放期为 14 个工作日，则第一个开放期为 2018 年 8 月 8 日-2018 年 8 月 27 日，第二个封闭期的起始日为 2018 年 8 月 28 日，则第二个封闭期的结束日为 2020 年 8 月 27 日（假设以上日期均非节假日）。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，场内份额可以在满足上市交易条件后在深交所上市交易。

本基金自前两个封闭期结束之后的第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的 2 日前进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。

本基金自第三个封闭期结束起，按照基金合同约定转为上市开放式基金（LOF），并更名为九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF），同时开放场内与场外份额的申购与赎回业务。本基金在转型前后可根据情况暂停上市与交易，恢复时间以本基金管理人公告为准。

### 二、申购和赎回场所

投资者办理本基金场外申购、赎回业务的场所为基金管理人的直销网点和其



它销售机构的销售网点；投资者办理本基金场内申购、赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 三、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

除法律法规或《基金合同》另有约定外，本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，开放期每日办理申购等业务。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直至满足《基金合同》关于开放期的时间要求。

除法律法规或《基金合同》另有约定外，本基金仅在开放期的第一个工作日对赎回申请进行受理。

在确定开放期后，基金管理人应在开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始与结束时间。

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、赎回等业务。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购价格为下一开放日办理基金份额申购的价格，基金份额持有人在开放期第一个工作日交易结束时间之后提出赎回申请的，赎回按失败处理。在开放期最后一个工作日交易时间结束之后提出有关申请的，基金管理

人将不予受理。

开放期以及开放期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。

#### 四、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率。

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。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、赎回等业务规则有新的规定，按新规定执行。

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

#### 五、申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者需根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资者在提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的基金份额余额，否则申购、赎回申请不成立。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资者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立。投资者在规定时间内全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

若申购不成立或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，

赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项，将款项通过销售机构划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

基金管理人可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介上公告并报中国证监会备案。

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

## 六、申购和赎回的数额限制

### 1、申购金额的限制

通过本基金指定代理销售机构场外申购基金，单笔申购的最低金额为 1,000 元；通过基金管理人直销中心的首次最低申购金额为 50,000 元，追加申购单笔最低申购金额为 10,000 元，不设级差限制（具体规定请至基金管理人网站查询）。

通过具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位场内申购基金，单笔申购最低金额为 1,000 元或其整数倍。

本基金存续期间对单个基金份额持有人不设置最高累计申购金额限制。

### 2、赎回份额的限制

基金份额持有人办理基金份额场外赎回时，赎回的最低份额为 5 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交易账户的基金份额余额少于 5 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎

回。

基金份额持有人办理基金份额场内赎回时，赎回份额必须是整数份额，且单笔赎回最多不超过 99,999,999 份基金份额。

3、对于场内申购、赎回及持有场内基金份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

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

#### 七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、申购费率和赎回费率

##### (1) 申购费率

基金份额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。

基金份额的申购费率具体如下表：

费用项	单笔金额 (M)	收费标准
申购费 (场内、场外)	M < 100 万元	1.5%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	1.0%
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

##### (2) 赎回费率

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。

基金份额的赎回费率具体如下表：

费用项	持有期限 (N)	收费标准
赎回费 (场外)	Y < 7 日	1.50%

	7日 $\leq$ Y<30日	0.75%
	30日 $\leq$ Y<365日	0.50%
	365日 $\leq$ Y<730日	0.25%
	Y $\geq$ 730日	0
赎回费（场内）	0.50%	

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对场外持有期少于30日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对场外持有期在30日以上（含）且少于90日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产；对场外持有期在90日以上（含）且少于180日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产；对场外持续持有期180日以上（含）的投资者所收取赎回费用总额的25%计入基金财产；其余用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。投资者通过场内赎回时，赎回费将全额归入基金财产。

在场外认购、场外申购的投资者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者，其份额持有期限自份额转托管至场外之日起开始计算。

（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，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（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者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按相关监管部门要求履行必要手续后，适当调低基金申购费率，并进行公告。

### 3、申购份额与赎回金额的计算及处理方式

#### （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，基金份额的有效申购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。

场内申购时，基金份额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。场内申购份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的申购资金零头退还投资者。

## 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) 申购份额的计算

基金份额以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例：某投资者投资10万元场外申购本基金，对应申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.628元，若投资者选择场外申购，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.628 = 60,517.30 \text{份}$$

即：若该投资者选择场外申购，则投资10万元，假设申购当日基金份额净值为1.628元，可得到60,517.30份本基金份额。

若投资者选择场内申购，场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得

份额为60,517份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还投资者。退款金额为：

$$\text{实际净申购金额} = 60,517 \times 1.628 = 98,521.68 \text{元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,521.68 - 1,477.83 = 0.49 \text{元}$$

### (3) 赎回金额的计算

场外基金份额以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用，场内基金份额以赎回总额为基数采取固定赎回费率计算赎回费用。基金份额的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{T日申请份额} \times \text{T日基金份额净值}$$

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

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

例：某投资者场外赎回本基金10万份，持有时间2年以上，对应的赎回费率为0%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.528 = 152,800.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 152,800.00 \times 0\% = 0 \text{元}$$

$$\text{赎回金额} = 152,800.00 - 0 = 152,800.00 \text{元}$$

即：投资者在场外赎回本基金10万份，持有时间2年以上，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为152,800.00元。

例：某投资者场内赎回本基金10万份，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.528 = 152,800.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 152,800.00 \times 0.50\% = 764.00 \text{元}$$

$$\text{赎回金额} = 152,800.00 - 764.00 = 152,036.00 \text{元}$$

即：投资者在场内赎回本基金10万份，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为152,036.00元。

## 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

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

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停申购情形时，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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项，以及因不可抗力导致基金管理人无法接受基金份额持有人的赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款



项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于已接受的赎回申请，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回部分，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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金开放期内的单个开放日和转为上市开放式基金（LOF）之后的前五个开放日，基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 20%；或本基金转为上市开放式基金（LOF）五个开放日后，单个开放日的基金净赎回申请（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%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

在本基金定期开放运作时与转为上市开放式基金（LOF）后五个开放日之前，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延缓支付。

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

（2）延缓支付：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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，基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的百分之二十，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日。

在本基金转为上市开放式基金（LOF）五个开放日之后，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者的全部赎回申请时，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者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 3、延缓支付的公告

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

### 4、巨额赎回的公告

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

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并

公布最近 1 个开放日或最近 1 个工作日（暂停时间超过 1 日时适用）的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间和基金份额净值的确定方式，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者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。

## 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。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；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

### 1、系统内转托管

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

---

(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基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理基金份额上市交易的会员单位（交易单元）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

## 2、跨系统转托管

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

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

## 十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在本基金的每个封闭期内，利用定向增发项目，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：

在封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

在开放期与基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计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

本基金在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的定增项目，将定向增发作为投资的主线，形成以定向增发为核心的投资策略。

#### 1、大类资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，结合主要大类资产的相对估值，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例，并适时进行动态调整。

#### 2、股票投资策略

在二级市场股票投资方面，本基金采用定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资。

本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系，并结合基金管理人的股票研究平台，多层面地分析具备改革新动力的上市公司所对应的公司治理和公司管理方面的优势和劣势，分析上市公司所处行业的波特五力结构、行业历史及行业变革力量，分析改革政策对公司的影响，从中选出将在改革中获益的上市公司，作为本基金的备选股票。

在定性分析的基础上，本基金的股票定量分析方法将分析备选股票的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，再通过比较市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平，并参考国际市场估值水平，来评估改革对备选股票价值提升带来的投资机会。

经过严格的定性分析和定量分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。

#### 3、定向增发股票投资策略

本基金根据定向增发本身的性质、发行对象、项目类别，对企业的实际影响细化为如下几个方面：

##### （1）大股东主导的定向增发投资

大股东主导的定向增发项目包括集团公司整体上市，实际控制人资产注入，

公司间资产置换重组中发行对象包含大股东或者大股东关联方，以及融资收购资产中收购大股东资产的几种定向增发项目。从根本上来说，此类项目不仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对大股东的增资目的、增发资产的质量等方面，对定向增发项目可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### （2）项目融资类定向增发投资

项目融资类的定向增发项目为定向增发项目中最常见的类别，目前市场上近一半的定向增发项目为项目融资类。

项目融资类的定向增发项目的特点在于公司在融资项目完成后，无法在短期显现其盈利能力。在项目完工后，公司的财务绩效逐步体现，公司盈利能力逐步改善。同时，募集资金的规模，机构投资者的认购比例对公司财务表现有一定的影响。

本基金对项目融资类定向增发项目将详细评估项目具体投资方向，预测其对企业基本面指标的影响，将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。

#### （3）非大股东方参与资产重组的定向增发投资

通过定向增发项目实现资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

由于此类资产重组为非大股东方参与，通常会对公司带来正面影响，本基金将关注资产重组类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

#### （4）融资收购非大股东方资产的定向增发投资

对于融资收购非大股东方资产的定向增发项目，长期来看，公司能够通过定向增发项目中收归的资产实现企业基本面指标的优化，通过上下游产业并购、合并同业竞争对手或跨行业并购实现公司主营业务的拓展，减少公司运营成本或大

幅提升市场占有率来重组企业现有资源，提升经营业绩。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

本基金将着重关注此类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

#### (5) 壳公司重组的定向增发投资

由于 A 股市场上上市公司的稀缺性，壳公司重组类的定向增发对壳公司的基本面产生重大改变。其具体运作模式为非上市公司购买壳收购目标成为上市公司，本基金在投资壳公司重组的定向增发项目时，会考察借壳公司过往业绩，股东情况，业务前景，壳公司资产负债剥离情况等一系列财务与基本面指标，并结合行业分析与估值，挑选具有吸引力能够带来长期稳定收益的股票。

本基金将深入研究不同类别的定向增发项目在不同期限内对公司基本面的影响，分析基本面变化，根据定向增发项目类别择优参加，尽可能获取定向增发项目给投资者带来的超额收益。

#### 4、债券投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 6、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。



## 7、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

## 8、股指期货的投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

（二）本基金转为上市开放式基金（LOF）后，基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，在有效控制组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

### 1、资产配置策略

本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

### 2、股票投资策略

股票投资策略方面，本基金采用定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资。

本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系。在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

在定性分析的基础上，本基金的股票定量分析方法将分析备选股票的估值指

标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，再通过比较市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平，并参考国际市场估值水平，来评估备选股票价值提升带来的投资机会。

### 3、固定收益投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。

### 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### 5、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

### 6、股指期货、权证等投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组

合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 在封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%-100%，非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于 80%；在开放期与基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过 20%；

(2) 在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。在开放期与基金转为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的

20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 在封闭期内，本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%；本基金转为上市开放式基金（LOF）后，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(16) 封闭期内，基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；在开放期与基金转为上市开放式基金（LOF）后，基金资产总值不得超过基金资产净值的

140%;

(17) 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%;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易按法律法规予以披露。重大关联交易

应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政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可不受上述规定的限制。

## 五、业绩比较基准

### 1、本基金业绩比较基准为：

沪深300指数收益率×60%+中债总指数（总值）财富指数收益率×40%

本基金股票投资部分选取沪深300指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国股票市场的状况；债券投资部分选择中债总指数（总值）财富指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国固定收益市场的状况，具有广泛的市场代表性。

2、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比较基准时，本基金管理人与基金托管人协商一致，可以变更业绩比较基准，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒介及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金品种。

## 七、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值；

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人或股东权利，保护基金份额持有人的利益；

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

## 八、基金投资组合报告

本公司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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 基金投资组合报告：

#### 1.1 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	493,293,730.88	55.73
	其中：股票	493,293,730.88	55.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	364,000,000.00	41.12
	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	26,297,389.04	2.97
8	其他资产	1,535,616.81	0.17
9	合计	885,126,736.73	100.00

#### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	40,052,481.74	4.54
C	制造业	317,715,522.60	35.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,600,287.28	3.01
E	建筑业	25,479,088.68	2.88
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,876,688.50	1.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,781,728.63	1.67

J	金融业	20,830,372.00	2.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,925,889.72	3.61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	4,031,671.73	0.46
	合计	493,293,730.88	55.85

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	3,015,382	65,614,712.32	7.43
2	603799	华友钴业	606,551	43,185,407.19	4.89
3	600339	中油工程	7,308,847	40,052,481.74	4.54
4	000519	中兵红箭	4,112,819	37,735,114.65	4.27
5	600277	亿利洁能	5,772,005	35,497,830.84	4.02
6	002157	正邦科技	6,263,036	34,352,752.46	3.89
7	300347	泰格医药	965,163	31,925,889.72	3.61
8	000862	银星能源	5,689,901	26,600,287.28	3.01
9	002611	东方精工	1,173,724	14,360,513.14	1.63
10	002310	东方园林	717,360	13,385,937.60	1.52

### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
报告期内，本基金未参与股指期货交易。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体之一中兵红箭股份有限公司在本报告期内出现被监管部门立案调查的情形。

中兵红箭涉嫌信息披露违法违规，被中国证监会立案调查，目前尚未收到中国证监会就上述立案调查事项的结论性意见。中兵红箭 2017 年 12 月 29 日最新公告如下：“2017 年 8 月 1 日，中兵红箭股份有限公司（以下简称“公司”）收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：湘稽调查字 0579 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司进行立案调查。公司已于 2017 年 8 月 2 日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网上披露了《中兵红箭股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》（公告编号：2017-58），并分别于 2017 年 9 月 1 日、2017 年 9 月 29 日、2017 年 10 月 31 日和 2017 年 11 月 29 日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网上披露了《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-75）、《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-83）、《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-88）和《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-90）。目前证监会调查工作仍在正常进行中，期间公司经营活动未受事件影响，经营情况正常。根据《深圳证券交易所股票上市规则（2014 年修订）》的相关规定，如公司因此受到中国证监会行政处罚，并在行政处罚决定书中被认定构成重大违法行为，或因涉嫌违规披露、不披露重要信息罪被依法移送公安机关的，公司将因

触及 13.2.1 条规定的重大信息披露违法情形，公司股票交易被实行退市风险警示。实行退市风险警示三十个交易日期限届满后次一交易日，公司股票将被停牌，直至深圳证券交易所停牌后的十五个交易日内作出是否暂停公司股票上市的决定。如公司所涉及立案调查事项最终未被中国证监会认定为重大信息披露违法行为，公司股票将不会因此次事件而被实施退市风险警示及暂停上市。截至本公告日，公司尚未收到中国证监会就上述立案调查事项的结论性意见，在此之前，公司将严格按照《深圳证券交易所股票上市规则（2014 年修订）》11.11.3 条的要求，每月至少披露一次调查进展提示性公告。”

本基金做出如下说明：本基金参与认购中兵红箭为募集配套资金而发行的股份，认购股份于 2017 年 1 月 26 日上市，解禁日期为 2018 年 1 月 26 日。中兵红箭股份有限公司实际控制人为中国兵器工业集团公司。目前，中兵红箭股份有限公司业务分为四大板块：智能弹药行业业务板块、专用车业务板块（冷藏保温汽车、爆破器材运输车等）、汽车零部件业务板块（汽车轴类零部件、内燃机配件等）、超硬材料板块（人造金刚石、立方氮化硼等）。报告期末证监会调查工作仍在正常进行中，期间公司经营活动未受事件影响，经营情况正常。今后，基金管理人将继续加强与该中兵红箭股份有限公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等中兵红箭股份有限公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，其他九名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 1.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	74,073.48
2	应收证券清算款	1,166,662.57
3	应收股利	-
4	应收利息	294,880.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,535,616.81

#### 1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002475	立讯精密	65,614,712.32	7.43	非公开发行股票 流通受限
2	600339	中油工程	40,052,481.74	4.54	非公开发行股票 流通受限
3	000519	中兵红箭	37,735,114.65	4.27	非公开发行股票 流通受限
4	603799	华友钴业	36,701,699.97	4.16	非公开发行股票 流通受限
5	600277	亿利洁能	35,497,830.84	4.02	非公开发行股票 流通受限
6	002157	正邦科技	34,352,752.46	3.89	非公开发行股票 流通受限
7	000862	银星能源	26,600,287.28	3.01	非公开发行股票 流通受限
8	002611	东方精工	14,360,513.14	1.63	非公开发行股票 流通受限
9	300347	泰格医药	14,204,200.68	1.61	非公开发行股票 流通受限
10	002310	东方园林	13,385,937.60	1.52	非公开发行股票 流通受限

#### 1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2016.08.30-2016.12.31	-0.38%	0.07%	-0.52%	0.44%	0.14%	-0.37%
2017.01.01-2017.12.31	3.03%	0.59%	12.15%	0.39%	-9.12%	0.20%
成立日-2017.12.31	2.64%	0.51%	11.56%	0.40%	-8.92%	0.11%

---

---

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十二部分 基金资产估值

### 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、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 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) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），在估值日采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价减去可转换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，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换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、配股和公开增发的股票，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、全国银行间市场交易的固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

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、股票指数期货合约估值方法：

（1）股票指数期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准；

（2）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

6、中小企业私募债，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。

7、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。

8、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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

自 2017 年 9 月 8 日起，本基金持有的流通受限股票根据中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》进行估值调整。具体请参见本基金管理人 2017 年 9 月 8 日发布的《九泰基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金持有流通受限股票估值方法的公告》。

#### 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 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或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，由基金管理人按约定对外公布。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

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、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。



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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基

金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 估值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，基金管理人应当通报基金托管人、报中国证监会备案并公告；

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准；

(4) 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/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

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和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

#### 八、特殊情况的处理

1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所、期货公司及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、市场规则变更等基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误的，由此基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，在本基金封闭期内，本基金每年收益分配次数最多为6次，每年不得少于1次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的90%；在本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红或红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金转为上市开放式基金（LOF）前，收益分配方式为现金分红；本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在注册登记系统的基金份额，收益分配方式为现金分红或红利再投资，登记在证券登记结算系统的基金份额收益分配方式为现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收

---

益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

场内基金份额收益分配时发生的费用，遵循深圳证券交易所和登记机构的相关规定。

## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

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

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性提取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

---

---

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

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

### 二、基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

## 第十六部分 基金份额转换

### 一、本基金自第三个封闭期结束起基金的存续形式

本基金自第三个封闭期结束起，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF），并更名为九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

本基金自第三个封闭期结束起，按照基金合同约定，将九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额等额转换为九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金份额。

本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额时，基金份额仍在深圳证券交易所上市交易，同时开放申购、赎回。本基金在转为上市开放式基金（LOF）前后可根据情况暂停上市与交易，恢复时间以本基金管理人公告为准。

### 二、本基金自第三个封闭期结束起的份额转换规则

对投资者认购，申购或通过二级市场购买并持有到期的每一份基金份额，本基金在第三个封闭期结束后第一个工作日，按照份额相等原则转换为九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额。无需支付转换基金份额的费用。

本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额时，基金总份额保持不变。

### 三、本基金自第三个封闭期结束起的投资管理

本基金自第三个封闭期结束起，本基金继续存续并转换为普通上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制会相应发生变化，具体变化参见基金的投资章节；根据基金合同的约定，相关变化符合混合型开放式基金的法律法规的规定。

### 四、本基金自第三个封闭期结束起的公告

（一）本基金自第三个封闭期结束后第一个工作日起，在符合本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续的相关事宜进行公告。

（二）本基金在第三个封闭期结束后第一个工作日起，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将在临时公告或在招募说明书中公告相关规则。管理人有权根据基金转换需求与交易所相关规定暂停交易或上市。基金管理人可



---

以修改相关规则，并将在临时公告或更新的招募说明书中公告。

（三）在本基金在第三个封闭期结束后第一个工作日前三十个工作日，基金管理人将进行提示性公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （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介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，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介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定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介上。

### （三）基金合同生效公告

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

### （四）上市交易公告书

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

### （五）基金资产净值、基金份额净值

1、封闭期内，在基金份额上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金份额上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基

金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值。

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

2、在本基金转为上市开放式基金（LOF）后，在开始办理申购或赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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

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

#### （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介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

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

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

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

### （八）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（基金合同另有约定的除外）；
- 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、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 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、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；

- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 27、中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。

#### （九）澄清公告

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

#### （十）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备案，并予以公告。

#### （十一）投资股指期货的信息披露

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

#### （十二）投资中小企业私募债的信息披露

基金管理人应当在本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介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。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。

#### （十三）投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比

例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十四）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

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

## 第十八部分 风险揭示

本基金投资过程中面临的主要风险包括市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、政策风险、本基金特有风险及其他风险。

### 一、市场风险

由于经济环境、产业和行业状况、公司基本面等方面的变化，可能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动，进而影响基金份额净值。市场风险主要包括：

1、经济周期风险：市场的收益水平随经济运行的周期性变动而变动，基金所投资于国债与上市或挂牌公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险；

2、利率风险：市场利率变动引起证券投资收益变动的可能性，市场利率的变化会引起证券价格变动，并进一步影响证券收益的确定性；

3、公司经营风险：如果基金所投资的上市公司经营不善，会导致其股票价格的下跌，或股息、红利减少，使基金投资收益下降，从而给基金的投资带来风险；

4、通货膨胀风险：由于通货膨胀、货币贬值给投资者带来实际收益水平下降的风险；

5、财务风险：公司财务结构不合理、融资不当而导致投资者预期收益下降的风险。

### 二、流动性风险

流动性风险包括两类。一是指投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面重大变化而导致流动性降低，基金管理人难以在合理的时间内以公允价格将其变现而引起资产的损失或交易成本的不确定性，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放期以及本基金转为上市开放式基金（LOF）后的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，进而影响基金份额净值。

### 三、信用风险



基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

本基金在投资过程中，主要面临以下两类信用风险：

第一类是所投资的债券自身的信用风险，包括：违约风险，主要是指债券发行人未能履行约定契约中的义务而造成经济损失的风险，即发行人不能履行还本付息的责任而使基金资产的预期收益与实际收益发生偏离所造成损失的风险；信用评级调整风险，主要是指由于经济周期、行业周期、公司经营管理等因素发生不利变化，致使债券发行人的财务状况恶化，偿债能力降低，由此造成债券信用评级降低、价格下跌，造成基金资产损失的风险。

第二类信用风险是债券交易对手的风险，主要是指在债券的交易过程中，由于交易对手方不能足额按时交割，导致本基金可能无法按时收到或足额收到应得的证券或价款而造成价款或证券的损失的风险，或者是指在回购交易的过程中，融资方无法按时支付回购本金和利息所带来的风险。

#### 四、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

#### 五、政策风险

政策风险是指政府各种经济和非经济政策的变化给公司所管理的基金资产带来的风险；政策风险包括：货币政策的变动、财政政策的波动、税收政策的变动、产业政策的变动、进出口政策的变动等政策的变动引发的市场价格变动，对公司所管理的基金资产带来的风险。

#### 六、其它风险

##### 1、操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

##### 2、技术风险

在基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

### 3、其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争及代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 七、本基金特有风险

### 1、折价风险

在本基金转为上市开放式基金(LOF)之前,以定期开放式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。封闭期内不办理申购与赎回业务,场内份额可以在满足上市交易条件后在深交所上市交易。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下,有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形,即基金折价交易,从而影响持有人收益或产生损失。

### 2、投资非公开发行股票风险

在封闭期内,本基金非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%;在开放期与本基金转为上市开放式基金(LOF)后,非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过20%。基金投资有明确锁定期的非公开发行股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值,故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值,投资者在申购赎回或在场内交易时,需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外,本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

### 3、基金投资中小企业私募债券的风险

本基金可投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是指中小微型企业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,其发行人是非上市中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。因此,中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。

---

#### 4、基金投资金融衍生品的风险

本基金可投资股指期货、权证等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来损失。

#### 5、基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、本基金自基金合同生效后，在任一开放期的最后一个开放日日终，基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元。自基金合同生效后第三个封闭期结束起，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

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

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、

估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为6个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算完毕后，基金托管人负责注销基金财产的资金账户、证券账户、债券托管专户账户以及其他相关账户。基金管理人应给予必要的配合。

#### 八、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利与义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (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、融券；
- (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、期货经纪机构

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、赎回等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、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，但向监管机构、司法机关、已出具保密承诺函的审计、法律等外部专业

顾问提供的除外；

(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活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。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账

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，因审计、法律等外部专业顾问要求必须提供的除外，但此种情形下应要求信息接收方严格履行保密义务；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，

基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (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、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 二、基金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。

本基金自第三个封闭期结束起，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人将按其所持上市开放式基金的每一基金份额享有相应的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

- （1）终止基金合同（连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形导致基金合同终止的情形除外）；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式，但本基金转为上市开放式基金（LOF）除外；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- （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) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、以下情况在法律法规和基金合同规定的范围内，对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、变更收费方式、调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、本基金自基金合同生效后，在任一开放期的最后一个开放日日终，有下列情形之一的，基金管理人应当终止基金合同：

(1) 基金份额持有人数量不满200人的；

(2) 基金资产净值低于5000万元的。

由上述情形导致基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

自基金合同生效后第三个封闭期结束起，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

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

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之

一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。法律法规另有规定的，从其规定。

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或大会公告载明的其他方式进行表决。

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

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



3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体授权方式在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，基金份额持有人也可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，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、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

#### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、本基金自基金合同生效后，在任一开放期的最后一个开放日日终，基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元。自基金合同生效后第三个封闭期结束起，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算

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

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

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、

估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

##### (四) 清算费用

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

##### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

##### (六) 基金财产清算的公告

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

(七) 基金财产清算完毕后，基金托管人负责注销基金财产的资金账户、证券账户、债券托管专户账户以及其他相关账户。基金管理人应给予必要的配合。

##### (八) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

---

---

#### 四、争议的处理

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（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

---

---

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室

法定代表人：卢伟忠

成立日期：2014年7月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2014]650号

注册资本：2亿元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

存续期间：2014年7月3日至长期

电话：010-57383999

传真：010-57383966

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：易会满

电话：010-66105799

传真：010-66105798

联系人：郭明

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款；同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现；各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券资金清算业务（银证转账）；保险兼业代理业务（有效期至2018年08月27日）；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务、年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定对下述基金投融资比例进行监督：



(1) 按法律法规的规定及基金合同的约定, 本基金的投资资产配置比例为: 在封闭期内, 股票资产占基金资产的比例为 0%-100%; 非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

在开放期与基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 股票资产占基金资产的比例为 0%-95%; 非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过 20%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的, 以变更后的比例为准, 但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。

基金管理人须向基金托管人定期提供与前述投资范围对应的股票清单, 基金托管人仅根据该股票清单监督本基金的投资范围和比例。

(2) 根据法律法规的规定及基金合同的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:

1) 在封闭期内, 股票资产占基金资产的比例为 0%-100%; 非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于 80%。在开放期与基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 股票资产占基金资产的比例为 0%-95%; 非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过 20%;

2) 在封闭期内, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。在开放期与基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%;

3) 本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%;

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;

5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产

净值的 0.5%；

8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

15) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 封闭期内，本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%；本基金转为上市开放式基金（LOF）后，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额

不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

16) 封闭期内，基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；在开放期与基金转为上市开放式基金（LOF）后，基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

17) 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%；

18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

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。期间，基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金禁止从事下列行为：

#### （1）承销证券；

- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；

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

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施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。基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。基金管理人应事先将关联交易的相关材料提交基金托管人，相关交易按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

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

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

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

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

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

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

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

## 6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

## 7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

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

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

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

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

间进行审核。

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

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

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

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

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

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

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反基金合同约定的，应

当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据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。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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

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

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，



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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### （二）募集资金的验证

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募集专户。该账户由登记机构管理。基金募集期满，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，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，登记机构应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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事宜。

##### （三）基金的银行账户的开立和管理

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

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方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。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1、基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

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

(七) 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 20 年以上。

## 五、基金资产净值计算与会计核算

### (一) 基金资产净值的计算

#### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合基金合同及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值、基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按约定对基金净值予以公布。

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

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

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

### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

#### （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) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），在估值日采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值；

3) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价减去可转换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，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换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) 全国银行间市场交易的固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

(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，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。

(6) 股票指数期货合约估值方法：

1) 股票指数期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准；

2) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) 小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(7) 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。

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。

### （三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

### （四）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第（7）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券交易所、期货公司及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### （五）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对

会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在基金合同生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 30 日内完成半年度报告，在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 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。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。

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

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 20 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

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

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经



友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

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

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

### （二）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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

5、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止后，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) 将清算报告报告中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

7、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（三）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。

---

（四）基金财产清算完毕后，基金托管人负责注销基金财产的资金账户、证券账户、债券托管专户账户以及其他相关账户。基金管理人应给予必要的配合。

（五）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十二部分 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，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担相关责任。

### 一、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心(包括电话呼叫中心和网站账户自动查询系统)和本基金管理人的销售网点查询历史交易记录。

### 二、基金份额持有人的对账单服务

1、基金份额持有人可登录基金管理人网站 ([www.jtamc.com](http://www.jtamc.com)) 查阅交易对账单。

2、基金份额持有人可向基金管理人客户服务中心订制电子邮件或短信形式的交易对账单。

交易账单的查阅和订制具体方法可参见基金管理人网站或拨打客服热线咨询。

### 三、投诉受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网站在线客服、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和代销机构所提供的服务进行投诉。

### 四、服务联系方式

#### 1、客户服务中心

投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打如下电话：400-628-0606（免长途话费）。投资者如果认为自己不能准确理解本基金《招募说明书》、《基金合同》的具体内容，也可拨打上述电话详询。

传真：010-57383866

#### 2、互联网站及电子信箱

网址：[www.jtamc.com](http://www.jtamc.com)

---

电子信箱: [service@jtamc.com](mailto:service@jtamc.com)

## 第二十三部分 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，并在指定媒介上公告。

报告期内本基金及基金管理人的有关更新公告：

公告事项	法定披露方式	法定披露日
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-05
关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2017-09-07
九泰基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金持有流通受限股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-08
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-09
关于增加世纪证券有限责任公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-13
关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-15
关于增加上海云湾投资管理有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-19
九泰基金管理有限公司关于调整旗下部分深圳证券交易所上市开放式基金场内份额持有期规则的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-09-29
九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新 2017 年第 2 号	证监会指定报刊和公司网站	2017-10-14
关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-10-23
九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2017-10-25
九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-10-25
关于增加上海万得基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-10-27
关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2017-11-02

九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-11-18
九泰基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-11-29
九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-12-08
九泰基金管理有限公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-12-11
关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2017-12-26
九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新信息及重新接受风险承受能力调查的公告-	证监会指定报刊和公司网站	2017-12-28
九泰基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017-12-30
九泰基金 2017 年 12 月 31 日资产净值公告	公司网站	2017-12-30
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2018-01-13
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2018-01-17
九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2018-01-22
九泰基金管理有限公司办公地址变更的公告	证监会指定报刊和公司网站	2018-01-30
九泰基金管理有限公司全资子公司九泰基金销售（北京）有限公司办公地址变更的公告	公司网站	2018-02-01
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2018-02-07
九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2018-02-10

---

---

## 第二十四部分 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，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者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。投资者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。



---

---

## 第二十五部分 备查文件

### 一、备查文件包括：

1、中国证监会准予九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2、《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、注册登记协议

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

8、证监会要求的其他文件

### 二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

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：投资者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。

九泰基金管理有限公司

2018年4月14日