

## 海富通富源债券型证券投资基金更新招募说明书

(2018 年第 1 号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

### 重要提示

本基金经 2016 年 7 月 12 日中国证券监督管理委员会【2016】1558 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2017 年 3 月 17 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通富源债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。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。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险、由于本基金股票、权证等权益类资产投资比例最高为 20%所带来的风险、本基金特有的风险等。本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。

本基金以 1.00 元发售面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在基金份额净值跌破 1.00 元发售面值的风险。本基金为债券型基金，其预期风险及收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险水平的投资品种。投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在申购本基金时应认真阅读本基金的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，自主做出投资决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 3 月 17 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日。

## 目 录

第一部分	绪言.....	1
第二部分	释义.....	2
第三部分	基金管理人.....	6
第四部分	基金托管人.....	16
第五部分	相关服务机构.....	21
第六部分	基金的募集.....	36
第七部分	基金合同的生效.....	37
第八部分	基金份额的申购与赎回.....	38
第九部分	基金的投资.....	48
第十部分	基金的业绩.....	60
第十一部分	基金的财产.....	62
第十二部分	基金资产的估值.....	63
第十三部分	基金的收益与分配.....	68
第十四部分	基金的费用和税收.....	70
第十五部分	基金的会计与审计.....	72
第十六部分	基金的信息披露.....	73
第十七部分	风险揭示.....	79
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	84
第十九部分	基金合同的内容摘要.....	86
第二十部分	基金托管协议的内容摘要.....	101
第二十一部分	对基金份额持有人的服务.....	118
第二十二部分	其他披露事项.....	121
第二十三部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	123
第二十四部分	备查文件.....	124

## 第一部分 绪言

《海富通富源债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“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》”）及其他有关规定以及《海富通富源债券型证券投资基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了海富通富源债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指海富通富源债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指海富通基金管理有限公司
- 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《海富通富源债券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《海富通富源债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《海富通富源债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《海富通富源债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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 日起实施的《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、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 22、销售机构：指海富通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，包括可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理有关业务的会员单位
- 23、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 24、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 25、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

26、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

27、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

28、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

29、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，最长不得超过三个月

30、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

33、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

35、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

36、《业务规则》：指《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守；投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的，还须遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则及其不时做出的修订

37、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

39、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

40、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，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为

基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

41、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

42、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及申购方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

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

44、元：指人民币元

45、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

46、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

47、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

48、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

49、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

50、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

51、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

52、中国：指中华人民共和国。就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区



## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

法定代表人：张文伟

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎资产管理 BE 控股公司  
49%。

### 二、主要人员情况

**张文伟先生**，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理，海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013 年 5 月起任海富通基金管理有限公司董事长。

**任志强先生**，董事、总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018 年 3 月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

**杨明先生**，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银

行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

**吴淑琨先生**，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

**Ligia Torres(陶乐斯)女士**，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996 年加入法国巴黎银行集团工作，2010 年 3 月至 2013 年 6 月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010 年 10 月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013 年 7 月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区 CEO。

**Alexandre Werno(韦历山)先生**，董事，金融硕士学位。2007 年 9 月至 2013 年 4 月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务；2013 年 5 月至 2017 年 11 月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017 年 11 月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

**郑国汉先生**，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

**Marc Bayot (巴约特)先生**，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学金融学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT 公司（布鲁塞尔）董事总经理、Degroof 资产管理（布鲁塞尔）独立董事，现任 Pioneer 投资公司（米兰，都柏林，卢森堡）独立董事、Fundconnect 独立董事和法国巴黎银行 B Flexible SICAV 独立董事。

**杨国平先生**，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党

委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

**张馨先生**，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

**李础前先生**，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

**Bruno Weil（魏海诺）先生**，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

**俞涛先生**，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月起任海富通基金管理有限公司产品与创新总监，2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

**陈虹女士**，监事，法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师，工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理，现任海富通基金管理有限公司法律部总经理。

**奚万荣先生**，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

**章明女士**，副总经理，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。2016年12月至2018年3月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

**陶网雄先生**，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上

海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**何树方先生**，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**陈轶平先生**，博士，特许金融分析师（CFA）。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞益债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月起兼任海富通富源债券和海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。

投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固定收益投资总监；杜晓海，多资产策略投资部总监；王金祥，研究部总监；陈轶平，固定收益投资副总监；赵赫，年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 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人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《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. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(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牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 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) 用基金资产承销证券;
- (9) 违反规定用基金资产向他人贷款或提供担保;
- (10) 用基金资产从事承担无限责任的投资;
- (11) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资;
- (12) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (13) 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营;
- (2) 违反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) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
- (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) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 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, 以提高自己;
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- (11) 以不正当手段谋求业务发展;

(12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(13) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，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) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### 五、基金管理人的内部控制制度

#### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制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；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；



(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性；

(8) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

## 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合，建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

## 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部，通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反

馈，保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的审计及风险管理委员会制定风险管理政策，由管理层的风险管理委员会负责实施，由风险管理部专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实，通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规性制度，以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制制度的声明

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

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

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

### 二、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。

### 三、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。

#### 四、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殊情况，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、资产托管部内部风险控制情况

(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。

## 五、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存在重大违规行为，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

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

法定代表人：张文伟

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：暴潇菡

电话：021-38650797

传真：021-33830160

##### (2) 销售机构

#### 1) 中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

电话：010-66106912

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

#### 2) 宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

#### 3) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦



法定代表人：周杰

客户服务电话：95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29F

法定代表人：杨德红

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

5) 安信证券股份有限公司

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

法定代表人：王连志

客户服务电话：95517

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

6) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客户服务电话：95579 或 4008888999

联系人：奚博宇

网址：www.95579.com

7) 东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

8) 光大证券股份有限公司

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

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

9) 广州证券股份有限公司

地址：广东省广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔

19 层、20 层

法定代表人：刘东

客户服务电话：95396

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

10) 国金证券股份有限公司

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

联系人：刘婧漪

网址：www.gjq.com.cn

11) 国联证券股份有限公司

地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

客户服务电话：95570

联系人：沈刚

网址：www.glsc.com.cn

12) 华龙证券股份有限公司

地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

客户服务电话：0931-95368（甘肃）、4006898888（全国）

联系人：范坤

网址：www.hlzq.com

## 13) 平安证券股份有限公司

地址：广东省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：詹露阳

客户服务电话：95511 转 8

联系人：周一涵

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

## 14) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：许曼华

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

## 15) 上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918 或 021-962518

联系人：邵珍珍

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

## 16) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045555 或 010-66045777 或 010-66045678（基金）

联系人：谭磊

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

## 17) 中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：95551 或 4008888888

联系人：邓颜

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

## 18) 中山证券有限责任公司

地址：广东省深圳市南山区科技中一路华强高新大厦 7-8 楼

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：95329

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

## 19) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

## 20) 中信证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

## 21) 中信证券（山东）有限责任公司

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

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：赵艳青

网址：www.citicssd.com

## 22) 中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

客户服务电话：4009908826

联系人：韩钰

网址：www.citicsf.com

23) 华西证券股份有限公司

地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584

联系人：周志茹

网址：www.hx168.com.cn

24) 宏信证券有限责任公司

地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008366366

联系人：张鋈

网址：www.hxzq.cn

25) 大同证券有限责任公司

地址：山西省太原市小店区长治路 111 号 12、13 层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007121212

联系人：薛津

网址：www.dtsbc.com.cn

26) 世纪证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜昧军

客户服务电话：4008323000

联系人：袁媛

网址：www.csc.com.cn

27) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

28) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

联系人：单丙焜

网址：www.erichfund.com

29) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：陆敏

网址：www.ehowbuy.com

30) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：李雁雯

网址：蚂蚁财富 APP

31) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

32) 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路 88 号金座 26 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

联系人：王超

网址： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

33) 和讯信息科技有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：刘洋

网址： [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

34) 北京展恒基金销售有限公司

地址：北京顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-000

联系人：罗恒

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

35) 众升财富（北京）基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人：李招弟

客户服务电话：400-876-9988

联系人：付少帅

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

36) 浙江同花顺基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：0571-88920897、4008-773-772

联系人：董一峰

网址： [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

37) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

法定代表人：陈操

客户服务电话：400-850-7771

联系人：文雯

网站：<https://t.jrj.com/>

38) 一路财富（北京）信息科技有限公司

法定代表人：吴雪秀

地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

客服电话：400-001-1566

联系人：徐越

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

39) 上海联泰资产管理有限公司

法定代表人：燕斌

地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

客服电话：4000-466-788

联系人：陈东

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

40) 北京增财基金销售有限公司

地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

联系人：史丽丽

网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

41) 北京钱景基金销售有限公司

地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

联系人：高静

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

42) 上海汇付金融服务有限公司

地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819



联系人：李栋

网址：www.chinapnr.com

43) 嘉实财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：余永键

网址：http://www.harvestwm.cn/

44) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

联系人：张晓辉

网址：http://www.taichengcaifu.com

45) 上海利得基金销售有限公司

地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

联系人：徐鹏

网址：http://www.leadbank.com.cn

46) 上海基煜基金销售有限公司

地址：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）

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

联系人：李鑫

网址：www.jiyufund.com.cn

47) 珠海盈米财富管理有限公司

地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

联系人：吴煜浩

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

48) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

联系人：王海焯

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

49) 北京虹点基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：胡伟

客服电话：400-068-1176

联系人：陈铭洲

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

50) 大泰金石基金销售有限公司

地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

法定代表人：袁顾明

客服电话：400-928-2266

联系人：赵明

网址：<http://www.dtfunds.com/>

51) 上海陆金所资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客服电话：4008 6666 18

联系人：程晨

网址：<https://www.lu.com>

52) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人:沈伟桦

客服电话: 400-6099-200

联系人: 刘梦轩

网址: <http://www.yixinfund.com/>

53) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人: 陈继武

客服电话: 4000-178-000

联系人: 王哲宇

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

54) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人: 彭运年

客服电话: 4008-909-998

联系人: 王莅晨

网址: <http://www.jnlc.com/>

55) 深圳富济财富管理有限公司

地址: 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层

法定代表人: 齐小贺

客服电话: 0755-83999907

联系人: 马利佳

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

56) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

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

法定代表人: TAN YIK KUAN

客服电话: 400-684-0500

联系人: 叶健

网址: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

57) 浙江金观诚财富管理有限公司

地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客服电话：400-068-0058

联系人：孙成岩

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

58) 上海大智慧财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 楼

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

联系人：施燕华

网址：<https://8.gw.com.cn>

59) 北京广源达信基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

联系人：崔丁元

网址：<https://www.niuniufund.com/>

60) 北京汇成基金销售有限公司

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

客服电话：400-619-9059

联系人：丁向坤

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

61) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

联系人：蔡之帆

网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

62) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

客服电话：010-62675369

联系人：吴翠

网址：<http://finance.sina.com.cn/fund/>

63) 南京苏宁基金销售有限公司

地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表：钱燕飞

客服电话：95177

联系人：喻明明

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

64) 北京蛋卷基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法人代表：钟斐斐

客服电话：4000-618-518

联系人：候芳芳

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

65) 中民财富管理（上海）有限公司

地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

法人代表：弭洪军

客服电话：400-876-5716

联系人：黄鹏

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

## 2、场内销售

本基金可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理基金销售业务的上海证券交易所会员单位进行销售。

基金管理人可以根据有关法律法规的要求，增加其他符合要求的机构销售本基金，并按照相关规定及时公告。

## 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  
注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人：周明  
电话：010-50938782  
传真：010-50938907  
联系人：赵亦清

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人：俞卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：孙睿  
经办律师：黎明、孙睿

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人：李丹  
经办注册会计师：薛竞、都晓燕  
电话：(021) 23238888  
传真：(021) 23238800  
联系人：都晓燕

## 第六部分 基金的募集

本基金于 2016 年 7 月 12 日经中国证监会【2016】1558 号文准予募集注册。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。募集期从 2017 年 1 月 11 日起至 2017 年 3 月 13 日止，共募集 338,875,516.91 份基金份额，有效认购户数为 751 户。

## 第七部分 基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2017 年 3 月 17 日正式生效。

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，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，本基金将根据基金合同的约定进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定时，从其规定。



## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行，其中销售机构包括场内销售机构和场外销售机构。场内销售机构为通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理基金销售业务的上海证券交易所会员单位；场外销售机构为直销机构和其他场外销售机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、申购与赎回的开放日及开放时间

#### 1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券、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

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

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

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、

赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

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；当日的场内申购与赎回申请在当日接受申报的时段内可以撤销；

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

5、场内申购、赎回需遵守上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须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的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销

售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、本基金单笔申购的最低金额为 10 元，销售机构在此最低金额基础之上另有约定的，从其约定。单笔场内申购的最低金额为 100 元，最高金额为 99,999,900 元，且须为 100 的整数倍。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，场外单笔赎回申请不得低于 10 份基金份额；场内单笔赎回须是整数份，且最高不能超过 99,999,999 份；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、单个投资人累计持有的基金份额不受限制。

4、本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 10 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于 10 份时，登记系统可对该剩余的基金份额自动进行全部赎回处理。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购费用和赎回费用

1、本基金的基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、申购费率按照申购金额逐级递减，登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
$M \geq 500$ 万元	按笔收取，1000 元/笔
$200 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$	0.40%
$100 \text{ 万元} \leq M < 200 \text{ 万元}$	0.60%
$M < 100$ 万元	0.80%

场内、场外销售的申购费率统一按照上表执行。

3、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。对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，具体费率如下：

份额持有期	赎回费率
30（含）天以上	0%
30 天以下	0.75%

场内、场外销售的赎回费率统一按照上表执行。

4、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。

5、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，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低申购费率。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算，计算公式如下：

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

（如适用固定金额申购费时，申购费用=固定金额申购费）

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

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

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资人；场外申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如，某投资者投资 5,000 元场外申购本基金，对应费率为 0.80%，假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 5,000 \times 0.80\% / (1 + 0.80\%) = 39.68 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 5,000 - 39.68 = 4,960.32 \text{ 元}$$

申购份额=4,960.32/1.1280=4,397.45 份

即：投资者投资 5,000 元场外申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元，则投资者可获得 4,397.45 份基金份额。

若该投资者通过场内申购，则可获得 4,397 份基金份额，不足一份的申购资金零头则由交易所会员单位返还投资者。

实际净申购金额=4,397×1.1280=4,959.82 元

退款金额=5,000-4,959.82-39.68=0.50 元

## 2、赎回金额的计算

投资者在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额 25 天后（未满 30 天）赎回，对应的赎回费率为 0.75%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1480=11,480.00 元

赎回费用=11,480×0.75%=86.10 元

净赎回金额=11,480-86.10=11,393.90 元

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金 25 天后（未满 30 日）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,393.90 元。

## 3、基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。计算公式为：

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额的余额数量

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。

## 九、申购与赎回的登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人T日申购基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人T日赎回基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 十、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人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常工作。

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人的申购申请。

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、基金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时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十一、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人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。
- 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人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、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，可暂停接受投资人的赎回申请。
- 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，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，以申请当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十二、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大

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

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（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、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。

## 十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日基金份额的基金份额净值。

3、若发生暂停的时间超过 1 日，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；基金管理人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，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十四、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。

### 十五、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### 十六、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人。

继承，是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

捐赠，指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；

司法强制执行，是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。

办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### 十七、基金的转托管

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

### 十八、定期定额投资计划

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

### 十九、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。法律法规另有规定的除外。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金以债券等固定收益类产品为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，通过积极主动的管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种，国债期货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）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%，扣除国债期货合约保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不超过基金资产净值的 15%，持有的卖出国债期货合约价值不超过基金持有的债券总市值的 30%。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。

#### 2、债券组合投资策略

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线

策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

(1) 久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

(2) 收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。通过合理期限安排，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，可以从长、中、短期债券的价格变化中获利。

(3) 类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。类属配置主要根据各部分的相对投资价值确定，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属，借以取得较高的总回报。

### 3、信用类债券投资策略

信用债券收益率可以分解为与其具有相同期限的无风险基准收益率加上反映信用风险的信用利差之和。信用利差收益主要受两方面的影响：一是该债券对应的信用利差曲线；二是该信用债券本身的信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略：

#### (1) 基于信用利差曲线变化策略

信用利差曲线的变化受宏观经济周期及市场供求两方面的影响较大，因此本基金一方面通过分析经济周期及相关市场的变化，判断信用利差曲线的变化，另一方面将分析债券市场的市场容量、市场形势预期、流动性等因素对信用利差曲线的影响，综合各种因素确定信用债券总的投资比例及分行业投资比例。

#### (2) 基于信用债信用变化策略

本基金主要依靠内部信用评级系统分析信用债的信用水平变化、违约风险及理论信用利差等。本基金信用评级体系将通过定性与定量相结合，着力分析信用债券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿。另外，评级体现将从动态的角度，分析发行人的资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键

因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略的变化。

#### 4、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。在流动性风险控制，本基金将重点放在一级市场，并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，严格防范流动性风险。

#### 5、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

#### 6、杠杆投资策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

#### 7、可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究。对于可转换债券的投资将主要从三个方面的分析：数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。

#### 8、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

## 9、股票投资策略

本基金的股票投资策略主要为个股精选策略，通过价值分析及成长性分析，兼顾个股的成长性和估值水平，寻找具有较强的持续成长能力，同时价值又没有被高估的股票主动投资。价值分析主要侧重公司的品质分析及估值水平分析。对于成长性分析，本基金管理人将重点关注企业的内涵式增长。本基金的股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用风险控制手段进行组合调整。

## 10、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金将在控制风险的前提下，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适当参与。

## 四、投资决策依据和程序

### 1、决策依据

- (1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- (2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- (3) 投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期或不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资部门负责人在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开部门例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基

基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资部门负责人授权下，根据部门例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见的基础上，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在债券分析师设定的债券池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 风险管理部负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金债券资产投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；

(2) 在每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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%；

(6) 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%；

(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过

该资产支持证券规模的 10%；

(8) 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%；

(9) 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；

(10) 本基金的资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金若参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与实现向交易所报告所交易和持有的卖出国债期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

3) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

4) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(12) 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%；

(13) 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%；

(14) 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%；

(15) 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%；

(16) 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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(17) 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，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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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、中国证监会及《基金合同》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的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，本基金管理人

在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

本基金债券部分的业绩比较基准为中证全债指数收益率，该指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

本基金股票部分的业绩比较基准为沪深300指数收益率，沪深300指数由中证指数有限公司编制和发布，是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数以成份股的自由流通市值进行加权，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场影响力。

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金采用稳健的大类资产配置策略，将不低于80%的基金资产配置于债券资产，力争获取相对稳健的回报，追求基金财产的保值增值。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金管理人可以与基金托管人协商一致报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险水平的投资品种。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人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股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 九、投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 月 11 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至 2017 年 12 月 31 日（“报告期末”）。

## 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	4,254,012.20	83.18
	其中：债券	4,254,012.20	83.18
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	624,972.31	12.22
7	其他资产	235,460.52	4.60
8	合计	5,114,445.03	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	297,553.00	6.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,956,459.20	79.76
	其中：政策性金融债	3,956,459.20	79.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,254,012.20	85.76

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	39,080	3,956,459.20	79.76
2	019563	17 国债 09	2,980	297,553.00	6.00

## 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。

## 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。

## 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。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未投资国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,713.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	233,747.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235,460.52

**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。

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

## 第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 12 月 31 日。

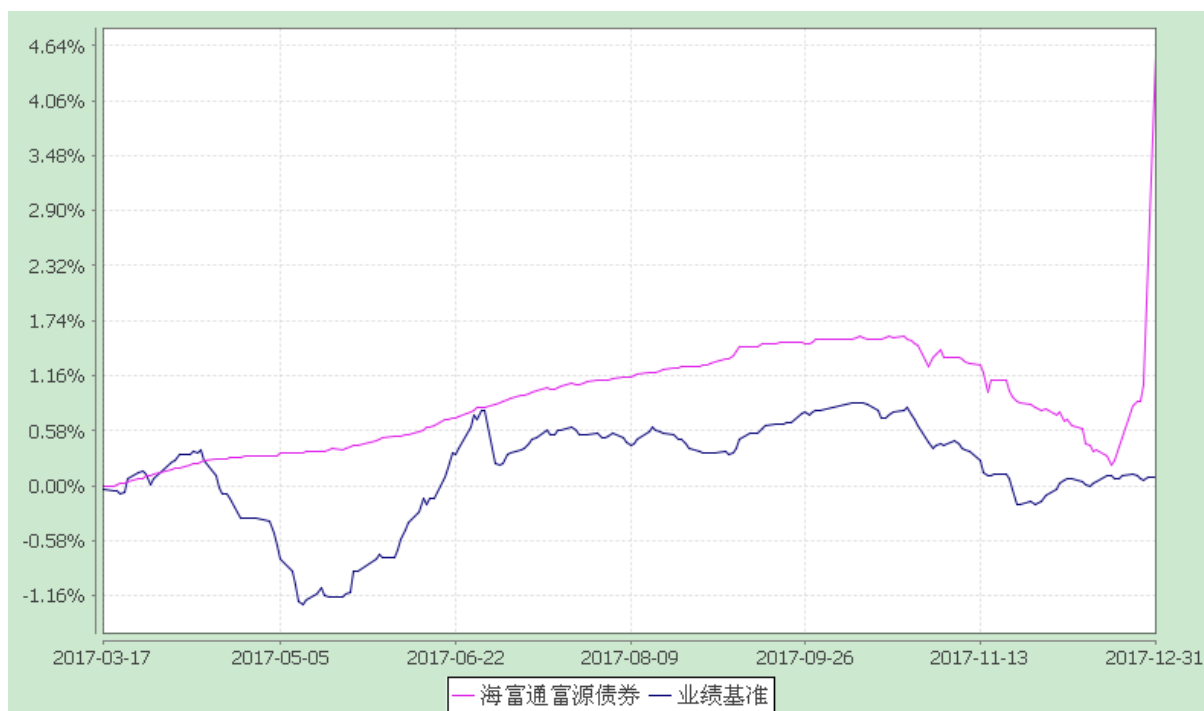
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 一、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2017年3月17日（基金合同生效日）-2017年12月31日	4.54%	0.18%	0.09%	0.05%	4.45%	0.13%

### 二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月17日至2017年12月31日)



注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 17 日生效，截至报告期末本基金合同生

效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。



## 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的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、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 基金资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、国债期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

#### 4、国债期货合约估值方法

国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、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。

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

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

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

## 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 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、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

4、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开放日交易结束后计算当日基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### **八、特殊情况的处理**

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人应免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 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，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的50%，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：现金分红与红利再投资，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；

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。

法律法规或监管机构另有规定的或在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。



## 第十四部分 基金的费用和税收

### 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、《基金合同》生效后的基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.7\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

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

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

上述“一、基金费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 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。

### 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的指定媒介披露，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其网站上，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各自网站上。

#### （二）基金份额发售公告

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

#### （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）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过其网站、基金份额发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。

### （五）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。

### （六）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其网站上，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其网站上，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。

### （七）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》；
- 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、本基金调整份额类别设置；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公

告。

#### （十）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。

#### （十一）投资国债期货信息披露

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）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债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券信息披露

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，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）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （十三）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



要在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。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、 投资于本基金的主要风险有：

#### （一） 本基金特有的风险

1. 本基金为债券型证券投资基金，投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，本基金将无法完全避免债券市场系统性风险。本基金投资于股票、权证等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%，因此，本基金除承担利率风险、信用风险和债券市场系统性风险外，还将面临股票市场的下跌风险。

2. 本基金在开放日可能出现巨额赎回，导致基金资产变现困难，进而出现延缓支付赎回款项的风险。

#### （二） 市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3. 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。特别地，如果上市公司涉嫌财务操纵、内幕交易、关联交易等

情形，或被监管部门处罚，将严重损害持有人利益。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

### （三）信用风险

当基金持有的债券、票据的发行人违约，不按时偿付本金或利息时，或交易对手违约时，将直接导致资产的损失，产生信用风险。本基金面临的信用风险包括：

（1）违约风险：债券或票据发行人不能按时履行其偿付本息和利息的义务，或回购交易中融资方违约无法按时支付回购本金和利息所带来的违约风险；

（2）降级风险：由于债券或票据发行人的基本面发生不利变化，导致其财务状况恶化、偿债能力降低等原因，信用评级机构调低债券及发行人信用等级的风险，从而导致债券价格下降的风险；

（3）信用利差风险：信用利差风险是指信用类债券当前的价格不合理，没有真实反映发行人的信用利差水平，并由此导致的预期信用利差放大从而债券价格下跌的风险；

（4）交易对手风险：在债券、票据、债券回购或协议存款的交易过程中，由于交易对手方不能足额按时交割，导致本基金可能无法收到或足额收到应得的证券或价款而产生损失，或导致基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

### （四）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

### （五）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难

度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### **（六）操作和技术风险**

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，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甚至导致基金持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券、期货交易所和证券登记结算机构等。

#### **（七）合规性风险**

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### **（八）收益率曲线风险**

收益率曲线风险是指与债券收益率曲线非平行移动有关的风险。本基金投资涉及债券收益率曲线策略，由于久期等指标对利率风险的衡量是建立在收益率曲线只发生平行位移的前提下，但收益率曲线可能会发生扭曲或蝶形等非平行变化，并导致久期等指标无法全面反映利率风险的真实水平。久期相同的货币市场工具组合若期限结构配置不同，则其收益率水平在收益率曲线发生非平行位移时会产生较大的差异。

#### **（九）杠杆放大风险**

本基金或采用杠杆操作、息差放大的投资策略，市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险均会相应增加，特别是，当收益率的实际走势与预期走势相反的情况下，市场出现融资的成本高于买入的债券的收益率，杠杆放大从而导致委托资产净值出现较大的损失。

#### **（十）资产支持证券风险**

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定

机构投资人发行，且仅在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

### （十一）中小企业私募债券风险

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

### （十二）国债期货风险

本基金以套期保值为主要目的或投资国债期货，国债期货的主要风险如下

（1）市场风险：国债价格的波动将可能影响国债期货合约的价格波动；国债期货合约价格的波动将直接影响基金资产净值；国债期货与现货合约以及国债期货不同合约之间价格差的波动可能导致特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。

（2）流动性风险：国债期货业务的流动性风险主要包括持仓组合变现的流动性风险和无法缴足保证金的资金流动性风险。持仓组合变现的流动性风险是指持仓品种变现时由于市场流动性严重不足、或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交而造成变现损失的风险；无法缴足保证金的资金流动性风险指当国债期货业务支付现金的义务大于组合现金头寸而发生流动性危机的风险。

（3）信用风险：信用风险指由于发行人或交易对手违约而产生损失的风险。由于国债期货业务持有的合约均为中金所场内交易的标准品种，因此该业务的信用风险较小。

（4）合规性风险：国债期货业务开展过程中，存在可能违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等方面的风险。

（5）国债期货实物交割风险：国债期货到期时采取实物交割方式，因此可能存在因实物交割导致被逼空的风险

### （十三） 其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

### 二、 声明

1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过中国工商银行等基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 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，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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 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。



## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (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) 在条件允许的前提下，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、期货经纪商或其他为

基金提供服务的外部机构；

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

(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；

(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、证券账户和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；

(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

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (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：

(1) 终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；

(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；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内及在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整基金份额类别设置、变更申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、对基金份额分类办法及规则进行调整；

(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以外的其他情形。

## (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及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）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（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的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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）基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(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、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开,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网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

#### (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 5 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。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》（除基金合同另有约定外）、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，自基金合同生效日起，凡与将来颁布的涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的，基金管理人与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，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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### (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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资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、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### （一）基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层  
(200120)

法定代表人：张文伟

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48 号

注册资本：1.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

### （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

传真：（010）66105798

电话：（010）66105799

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；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；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。

## 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：

具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种，国债期货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）。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%，扣除国债期货合约保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不超过基金资产净值的15%，持有的卖出国债期货合约价值不超过基金持有的债券总市值的30%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(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：

a、基金投资组合中债券资产不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类资产不高于基金资产的20%；

b、在每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

c、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

d、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

e、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%

f、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%；

g、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%。

h、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管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%；

i、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；

j、本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

k、本基金若参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

3) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

4) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

1、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%；

m、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%；

n、本基金管理人管理的全部基金持有且由本基金托管人托管的同一权证，不得超过该权证的 10%；

o、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%；

p、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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金管理人应在 10 个交易

日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围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。

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。

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、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

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，基金管理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。

5、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。

6、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存在重大违规行为，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和证券账户、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的基金份额净值、根据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。基金管理人有权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、证券账户和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，独立核算，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管理人在中国证券登记结算有限责任公司开立的基金备付金账户，该账户由基金管理人开立并管理。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，基金管理人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（“资产托管专户”）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 15 年以上。

## 五、基金资产净值计算与复核

### （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后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。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》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，由基金管理人对外公布。

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，按照基金管理人对外公布的结果为准。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、国债期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 2、估值方法

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

②交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构提供的相应

品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

①送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

(4) 国债期货合约估值方法

国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

(5) 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。

(6) 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。

由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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）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。

#### （五）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登记与保管

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利登记日、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，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。登记机构的保管期限自基金账户销户之日起不得少于20年。

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15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，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### （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。

## 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。



## 第二十一部分 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。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、资料寄送服务

基金管理人负责向通过基金管理人的直销中心认购或申购本基金的基金份额持有人寄送相关资料，基金销售机构将负责向通过其销售网点认购或申购本基金的基金份额持有人寄送相关资料。

#### 1. 投资人对账单服务：

基金份额持有人可通过以下方式查阅对账单：

- 1) 基金份额持有人可登陆本基金管理人的网站账户自动查询系统查阅对账单。
- 2) 对账单寄送服务分为电子对账单服务及纸质对账单服务。基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制纸质或电子形式的定期对账单，其中
  - a) 电子对账单服务：每月度、季度、年度结束后 15 个工作日内由客户服务中心向所有选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。
  - b) 纸质对账单服务：每年度结束后 30 个工作日内，客户服务部门将向本年度有交易的或持有份额的，系统内预留联系地址齐全的，且选择纸质对账单服务的基金份额持有人寄送纸质对账单。
- 3) 基金份额持有人也可拨打基金管理人客服热线索取电子或纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

#### 2. 其他相关的信息资料

介绍国内外金融市场动态、投资机会和投资产品等。

### 二、红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投

资于本基金，登记机构将基金份额持有人所获现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### 三、在线服务

通过基金管理人网站的在线客服、留言板和客服信箱，投资人可以实现咨询、投诉、建议和寻求各种帮助，与基金经理（或投资顾问）定期进行在线交流。

网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人为现有投资人提供了基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式设置、修改查询密码等服务。

### 四、资讯服务

投资人如果想了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打基金管理人客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询、查询。

#### 1、客户服务电话

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

#### 2、互联网站

基金管理人网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

#### 3、官方微信服务号：fund\_hft

### 五、投诉受理

投资人可以拨基金管理人客户服务中心电话或致函，投诉直销机构和销售机构的人员和服务。

### 六、网上开户与交易服务

基金管理人已开通网上交易平台，投资者可登陆海富通基金网站（[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)）或海富通官方微信服务号（fund\_hft）实现网上开户和交易（包括申购、赎回等），并获得申购费率优惠。海富通网上交易支持工商银行、农业银行、建设银行、中国银行、招商银行、民生银行、光大银行、平安银行、兴业银行、浦发银行、中信银行、上海银行、华夏银行等银行的借记卡

及天天盈等账户，具体的费率优惠标准请参见相关公告。基金管理人将依据业务发展状况，逐步增加网上交易支持的银行卡种，并以公告形式告知投资者。

**七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。**

## 第二十二部分 其他披露事项

### 一、基金登记机构

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

登记机构的更换程序：

(1) 提名：由基金管理人提名。

(2) 备案：新任登记机构报中国证监会审查资格并备案后，原任登记机构方可退任。

(3) 公告：基金登记机构更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在指定媒介上公告。

(4) 交接：原基金登记机构应做出处理基金登记事务的报告，并与新任基金登记机构完成业务移交手续，向新任基金登记机构提交完整的书面材料和电子数据；新任基金登记机构与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金登记机构仍有义务保留本基金正式移交日之前的登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金登记机构处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金登记机构业务移交产生的问题，原基金登记机构仍有协助解决之义务。

**2. 基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的登记业务。**

#### 3. 基金登记机构概况

基金登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：周明

注册资本：6 亿元

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证监会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有5个部门和2个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证监会是公司主管部门，公司业务接受中国证监会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证监会批准的其他业务。

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书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。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。上述备查的文件其内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

本招募说明书的备查文件包括：

- (1) 中国证监会对海富通富源债券型证券投资基金募集申请准予注册的文件
- (2) 《海富通富源债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《海富通富源债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (6) 法律意见书
- (7) 注册登记协议
- (8) 中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资人如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。