

# 融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书

(2019 年第 1 号)

基金管理人：融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

日 期：二〇一九年四月

## 重要提示

融通四季添利债券型证券投资基金经中国证监会 2011 年 10 月 21 日证监许可[2011]1683 号文核准募集，基金合同于 2012 年 3 月 1 日正式生效，依照融通四季添利债券型证券投资基金基金合同约定，基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易；基金合同生效满两年后，于 2014 年 3 月 3 日转换运作方式为上市开放式基金，基金名称变更为融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）。

2018 年 3 月 14 日经中国证监会《关于准予融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2018]465 号）准予变更注册，本基金于 2018 年 3 月 29 日至 2018 年 5 月 1 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2018 年 5 月 2 日决议通过《关于修改〈融通四季添利债券型证券投资基金基金合同〉的议案》，修改后的基金合同自 2018 年 5 月 3 日起生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对本基金的变更注册，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。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本更新招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本基金是债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、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，利率风险，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，债券投资出现亏损的风险；基金运作风险，

包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。

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，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。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2019年3月1日，有关财务数据截止日和净值表现截止日均为2018年12月31日。（本报告中财务数据未经审计）

## 目 录

第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	10
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 基金的历史沿革.....	46
第七部分 基金的存续.....	47
第八部分 基金份额的上市交易.....	48
第九部分 基金份额的申购、赎回与转换.....	49
第十部分 基金的投资.....	63
第十一部分 基金的业绩.....	74
第十二部分 基金的财产.....	75
第十三部分 基金资产的估值.....	76
第十四部分 基金的收益分配.....	81
第十五部分 基金的费用与税收.....	83
第十六部分 基金的会计与审计.....	85
第十七部分 基金的信息披露.....	86
第十八部分 风险揭示.....	91
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	94
第二十部分 基金合同的内容摘要.....	96
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要.....	110
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	126
第二十三部分 其他应披露事项.....	128
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	130
第二十五部分 备查文件.....	131

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规及《融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本招募说明书由融通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合同当事人之间权利、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：指融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)
- 2、基金管理人：指融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、基金合同或《基金合同》：指《融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)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《融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)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《融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其定期的更新
- 7、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
- 8、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 9、《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
- 10、《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
- 11、《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
- 12、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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，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：指融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，以及取得基金销售业务资格、可以通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

23、注册登记业务：基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

24、注册登记机构：融通基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构

25、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司基金注册登记系统，又简称为TA系统

26、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

27、会员单位：指经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的交易所会员单位

28、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、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、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。投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场

内申购、场内赎回、上市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注册登记机构的证券登记结算系统

30、交易账户：指各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基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

31、场外：指通过深圳证券交易所外各销售机构办理基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

32、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

33、上市交易：指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

34、基金合同生效日：指《融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》生效日

35、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

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

39、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

40、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、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

42、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则及对其不时做出的修订

43、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

44、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

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



## 金基金份额的行为

46、系统内转托管：指基金份额持有人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

47、跨系统转托管：跨系统转托管只限于在证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行，指投资者将基金份额在证券登记结算系统内某会员单位（交易单元）与注册登记系统内的某销售机构（网点）之间进行转托管的行为

48、定期定额投资计划：投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

49、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%

50、元：指人民币元

51、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

52、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

53、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、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

55、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

56、货币市场工具：现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

57、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、基金合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

58、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方

式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

59、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

60、不可抗力：指本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、基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司

住所：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

设立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：高峰

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

电话：（0755）26947517

联系人：赖亮亮

注册资本：12500 万元人民币

股权结构：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

#### 二、基金管理人主要人员情况

##### 1、现任董事情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015 年 7 月起至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，经济学博士，民进会员，注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计，吉林大学教师、讲师、教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士后、执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，法学博士，现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012 年 1 月至今，任公司独立董事。

董事王利先生，工学学士，现任新时代证券股份有限公司总经理助理兼公司内核负责人、场外市场部负责人。历任中石化齐鲁分公司财务部会计，上海远东证券有限公司总经理助理兼稽核部总经理，新时代证券股份有限公司总经理助理兼合规管理部、法律事务部总经理。

2018年2月至今，任公司董事。

董事杨宗兵先生，中国语言文学博士后，现任明天控股有限公司干部与业务管理中心副总裁。历任安徽省池州市第八中学高中语文教师，中国图书进出口(集团)总公司党委组织部部长，新兴际华集团有限公司党群工作部部长、党委书记、董事、集团党委副书记、机关党委书记（副厅级）。2018年3月至今，任公司董事。

董事王裕闵先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司副总裁、全球投资主管兼首席投资官（国际），兼任ARK Investment Management GP LLC董事会列席代表。历任M&T Bank 分析员，FGIC（GE Capital 通用资本的子公司）交易员，General Reinsurance 基金经理，CGA Investment Management 高级基金经理，Structured Credit Partners LLC 联合创始人兼首席投资官，Wachovia Corporation 董事总经理兼全球结构信贷产品主管、董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主管，宏利资产管理（Manulife Asset Management）香港亚洲固定收益产品主管，日兴资产管理有限公司首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投资官（国际）。2018年3月至今，任公司董事。

董事 Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司（日本东京）经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今，任公司董事。

董事张帆先生，工商管理硕士，清华大学 EMBA。历任新时代证券经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司董事。

## 2、现任监事情况

监事刘宇先生，金融学硕士、计算机科学硕士，现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今，任公司监事。

## 3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今，任公司董事长。

总经理张帆先生，工商管理硕士，清华大学 EMBA。历任新时代证券经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司总经理。

常务副总经理 Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司（日本东京）经理、日兴资产管理有限公司部长。2011年3月

至今，任公司常务副总经理。

督察长涂卫东先生，法学硕士。历任国务院法制办公室（原国务院法制局）财金司公务员，曾在证监会法律部和基金监管部工作，曾是证监会公职律师。2011年3月至今，任公司督察长。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理情况

王超先生，金融工程硕士，经济学、数学双学士，11年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行（现更名为平安银行）债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012年8月加入融通基金管理有限公司，现任融通债券、融通四季添利债券（LOF）、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通通泰保本混合、融通汇财宝货币、融通易支付货币、融通通宸债券、融通通优债券基金的基金经理。

余志勇先生，武汉大学金融学硕士、工商管理学学士，18年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司研究部总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、行业组长，现任融通通泰保本混合、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通四季添利债券基金（LOF）的基金经理。

##### （2）历任基金经理情况

自2012年3月1日起至2012年8月30日，由乔羽夫先生和蔡奕奕女士共同担任本基金的基金经理。

自2012年8月31日起至2015年3月13日，由蔡奕奕女士担任本基金的基金经理。

自2015年3月14日起至2016年10月27日，由王超先生担任本基金的基金经理。

自2016年10月28日起至今，由王超先生和余志勇先生共同担任本基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

公司固定收益公募基金投资决策委员会成员：固定收益投资总监、基金经理张一格先生，固定收益部总监、基金经理王超先生，交易部总经理谭奕舟先生，风险管理部总经理马洪元先生。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

#### 1、依法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申购、赎回和

登记事宜；如认为基金销售机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议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；

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内发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

管人；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

25、建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

26、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、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

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

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

（1）将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）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；

（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）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、对倒和倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 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；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须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。

## 六、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、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

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，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在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、操作守则等的具体说明。

### 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

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

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自

有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，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。

### 3、主要内部控制制度

#### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

#### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

#### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司任何会议，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。督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部监察稽核管理办法、内部监察稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的有关情况；检查公司各业务

部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

4、基金管理人关于内部控制制度的声明

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基金托管人的基本情况

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 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 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 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十五年获得香港《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 61 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。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银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。

### 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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，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、基金份额销售机构

#### （一）直销机构

##### （1）融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：陈思辰

电话：（0755）26948034

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）26948088

##### （2）融通基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 84 号丰汇时代大厦东翼 5 层 502-507 房间

邮政编码：100032

联系人：魏艳薇

电话：（010）66190989

##### （3）融通基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 34 层 3405 号

邮政编码：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：（021）38424889

##### （4）融通基金管理有限公司网上直销

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

#### （二）其他销售机构

##### （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

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

电话：（010）66107900

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

客服电话：95533

联系人：王琳

电话：（010）66275654

（3）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566

（4）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

联系人：张作伟

电话：（021）58781234

（5）民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

联系人：董云巍

（6）招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

客服电话：95555

（7）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

开放式基金咨询电话：(021)962888

联系人：汤征程

联系电话：(021)68475888

（8）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街甲 17 号

法定代表人：张东宁

联系人：王曦

电话：(010) 66223584

客户服务电话：95526

（9）平安银行股份有限公司

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5 0 4 7 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客户服务电话：95511-3

（10）宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 24 层

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

（11）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客服热线：95528

公司网站 [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（12）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：0571-88920897 4008-773-772

（13）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元

法定代表人：赵学军

联系人：景琪

电话：010-65215266

传真：010-85097308

客户服务电话：400-021-8850

（14）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 层

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

联系人：陈云卉

客服热线：400-820-2819

（15）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：（010）66045608

客服电话：（010）66045678

传真：010-66045521

（16）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：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：杨懿

联系人：文雯

电话：010-83363101

（17）深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

联系人：马力佳

客服热线：0755-83999907

公司网站：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

（18）上海陆金所基金销售有限公司（仅销售前端）

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

（19）珠海盈米基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

客服热线：020-89629066

（20）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

联系人：吕慧

电话：（021）58788678

（21）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客户服务电话：400-918-0808

公司网站：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

（22）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

电话：021-38509735

传真：021-38509777

联系人：李娟

客服热线：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（23）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：高莉莉

客服热线：4001818188

公司网站：1234567.com.cn

（24）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20213600

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服热线：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

（25）上海利得基金销售有限公司

注册地址：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

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

（26）北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法人代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059 ；

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

（27）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号1幢A2008室

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

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

（28）北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：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

电话：010-57418813

传真：010-57569671

联系人：崔丁元

客服热线：4008936885

公司网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

（29）大泰金石基金销售有限公司

办公地址：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

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：021-20324153

（30）奕丰基金销售有限公司

注册地址：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）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：0755-8946 0500

传真：0755-2167 4453

联系人：叶健



客服热线：400-684-0500

公司网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

（31）北京肯特瑞基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济技术开发区科创十一街18号京东集团总部A做17层

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

客服热线：95518

公司网站：[jr.jd.com](http://jr.jd.com)

（32）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

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

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：葛亮

客服热线：400-618-0707

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

（33）上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

法定代表人：王翔

客服电话：021-65370077

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

（34）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

联系人：李静如

客服热线：4008188000

公司网站：<http://www.myfund.com/>

（35）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

联系人：姜吉灵

客服热线：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（36）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

邮编：200335

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

（37）万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

电话：010-59013828

传真：010-59013707

联系人：王芳芳

客服热线：010-59013842

公司网站：<http://www.wanjiawealth.com/>

（38）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：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

电话：010-88066632

传真：010-63136184

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

公司网站：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

（39）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：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

电话：010-59336539

传真：010-59336500

联系人：徐英

客服热线：4008-909-998

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

（40）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：戚晓强

客服热线：4000618518

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

（41）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

法定代表人：夏予柱

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：胡明哲

客服热线：400-8557333

公司网站：[www.jhfund.com](http://www.jhfund.com)

（42）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：冷飞

电话：021-50810687

传真：021-58300279

联系人：李娟

客服热线：021-50810673

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

（43）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

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

（44）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（45）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客服热线：95156

网址：[www.tonghuafund.com](http://www.tonghuafund.com)。

（46）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：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

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

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

（47）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027817

传真：0411-39027835

联系人：辛志辉

客服热线：4000899100

公司网站：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

（48）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：占文驰

电话：（0791）86283372

客服电话：4008222111

（49）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001 或 95553

（50）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：李晓哲

电话：（021）22169130

客服电话：95525

（51）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：（021）68752206

客服电话：95579 或 4008-888-999

（52）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：（010）85130236

客服电话：400-8888-108 或 95587

（53）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

联系人：韩秀萍

电话：（010）85252656

客户服务电话：4006198888

（54）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（55）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：（0551）65161821

客服电话：（0551）96518、400-80-96518

（56）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：（010）83561146

客服电话：400-698-9898

（57）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：（010）66568292

客服电话：4008-888-8888

（58）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：杨鹏军

电话：（0551）2207114

客服电话：95578，400888777

（59）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

电话：（021）38676767

客服电话：400888666

（60）申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：（021）33388215

客服电话：95523 或 4008895523

（61）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：（0512）62938521

客服电话：4008601555

（62）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄蝉君

电话：（0755）83285134

客服电话：4008881111、95565

（63）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼



法定代表人：何之江

联系人：周一涵

电话：（021）38637436

客服电话：95511-8

（64）第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：李晓伟

电话：（010）63197785

客服电话：4008881888

（65）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：陈牧原

联系人：邓鹏怡

电话：（0931）8490208

客服电话：96668

（66）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63080994

客服电话：4008008899

（67）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383600

客服电话：96326

（68）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

法定代表人：罗钦城

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话：400-8888-133

（69）中信证券股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

电话：(010) 60838995

客服电话：4008895548

（70）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

（71）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199599-8166

客服电话：(0755) 83199509

（72）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：(0755) 82492193

客服电话：95597

（73）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

法定代表人：徐朝晖

联系人：刘莹

电话：（029）87406649

客服电话：95582

（74）国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

电话：（0755）83707413

客服电话：95563

（75）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

电话：（0431）85096517

客服电话：4006000686

（76）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：（020）87555888-8333

客服电话：95575

（77）恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4974437

客服电话：4001966188

（78）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法人代表：李长伟

联系人：马焮

电话：010-88321613

客服热线：0871-68898130

（79）中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：0755-82791065

客服热线：4009908826

（80）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

电话：010-85679888-6035

客服电话：4009101166

（81）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客服电话：4006-600109

（82）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：秦雨晴

电话：021-20315255

客户服务电话：95538

（83）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

（84）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系人：许爽

客服电话：4008188866

（85）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16—26层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：（0755）82130833

客服电话：95536

（三）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，并及时公告。

## 二、注册登记机构

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

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

联系电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

## 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

经办律师：安冬、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

#### 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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：薛竞、俞伟敏

## 第六部分 基金的历史沿革

融通四季添利债券型证券投资基金经中国证监会 2011 年 10 月 21 日证监许可[2011]1683 号文核准募集，基金合同于 2012 年 3 月 1 日正式生效，依照融通四季添利债券型证券投资基金基金合同约定，基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易；基金合同生效满两年后，于 2014 年 3 月 3 日转换运作方式为上市开放式基金，基金名称变更为融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）。

2018 年 3 月 14 日经中国证监会《关于准予融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2018]465 号）准予变更注册，本基金于 2018 年 3 月 29 日至 2018 年 5 月 1 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2018 年 5 月 2 日决议通过《关于修改〈融通四季添利债券型证券投资基金基金合同〉的议案》，修改后的基金合同自 2018 年 5 月 3 日起生效。

## 第七部分 基金的存续

《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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。



## 第八部分 基金份额的上市交易

### 一、上市交易的时间和地点

本基金于2012年4月6日开始在深圳证券交易所上市交易。

本基金登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的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后，方可上市交易。

### 二、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守有关规定，包括但不限于：

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

### 三、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有关规定办理。

### 四、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基金前一交易日的基金份额净值。

### 五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

六、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。

七、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。

## 第九部分 基金份额的申购、赎回与转换

投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购、赎回，可通过场外方式对本基金进行转换。

### 一、申购、赎回与转换场所

本基金场外申购、赎回与转换场所为基金管理人的直销网点及基金场外销售机构的销售网点；场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。具体的销售网点和办理申购赎回业务的会员单位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。

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、赎回与转换。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，投资者可以通过上述方式进行申购、赎回与转换，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、申购、赎回与转换的开放日及时间

#### 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、赎回或转换，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、赎回或转换时除外。开放日的具体业务办理时间在相关公告中载明。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券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、赎回与转换开始日及业务办理时间

本基金于2014年3月3日起开始办理日常申购、赎回业务。

本基金已于2016年2月25日及后续公告的相关日期起，开放通过直销机构及部分代理销售机构办理本基金的场外份额与本基金管理人管理的其他基金之间的转换业务。详情请查看公司网站或相关公告。

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、赎回或转换业务。如果本基金接受投资者在基金合同约定之外的日期或者时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### 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、场外的基金份额赎回遵循“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；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，当日开放时间结束后不得撤销；

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。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、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行；

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

### 四、基金转换的原则

1、“未知价”原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金份额净值为基准进行计算；

2、采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请；

3、基金转换无基金份额持有时间限制；

4、基金转换转出的基金在申请日有权益，确认日开始无权益；基金转换转入的基金在申请日无权益，确认日开始记权益；

5、转入的基金份额的持有时间自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算；

6、在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态；

7、在发生限制申购或巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。如果发生连续巨额赎回，基金转换不顺延；

8、由于费率结构差异较大，因此，基金转换只允许在缴纳前端申购费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购费用的基金份额转换为缴纳后端申购费用的基金份额，或将缴纳后端申购费用的基金份额转换为缴纳前端申购费用的基金份额；

9、转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即份额注册日期在前的优先转出，份额注册日期在后的后转换出；

10、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、赎回与转换的程序

### 1、申购、赎回与转换的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回或转换的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回或转换申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回或转换的申请无效而不予成交。

投资者办理申购、赎回或转换等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《基金合同》和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

### 2、申购、赎回与转换申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购、赎回与转换申请的当天作为申购或赎回或转换申请日(T日)，T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购、赎回与转换的成交情况。

基金销售机构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请。申请的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3、申购与赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须采用全额缴款方式，投资人交付申购款项，申购成立，登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购不成立或无效，申购款项将退回投资者账户。

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。投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

## 五、申购、赎回与转换的数量限制

1、场外申购时，投资者通过其他销售机构和直销机构网上直销申购本基金，首笔申购最低金额（含申购费）为1元，投资者追加申购时单笔最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构网点公告；通过直销机构直销网点申购本基金，首笔申购最低金额（含申购费）为10万元，追加申购单笔最低金额（含申购费）为10万元。

场内申购时，每笔申购金额最低为1元，同时申购金额必须是整数金额。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分基金份额赎回，场外单笔最低赎回、单笔最低转换转出及最低账户持有份额的限额均为 1 份，如投资者在销售机构托管的本基金份额余额不足 1 份，则必须一次性赎回或转出该基金全部份额。若某笔赎回、转换转出将导致投资者在销售机构托管的本基金余额不足 1 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的本基金剩余份额一次性全部赎回。各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，需同时遵守销售机构的相关规定。投资者在场内单笔最低赎回份额不得低于 1 份；场内最低持有份额不得低于 1 份。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购金额、赎回或转换份额等数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### 七、申购、赎回与转换的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 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、申购或转换入份额及余额的处理方式：本基金的场外申购或转换入有效份额为按实际确认的申购或转换入金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算并保留小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购份额保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

3、赎回或转换出金额的处理方式：本基金的赎回或转换出金额按实际确认的有效赎回或转换出份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用。计算结果保留小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 4、申购、赎回与转换费率

##### （1）申购费率

投资者通过场内或场外申购本基金份额时需交纳申购费。本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

场内/场外	申购金额（M）	申购费率
-------	---------	------

申购费	M < 100 万	0.80%
	100 万 ≤ M < 500 万	0.50%
	M ≥ 500 万	单笔 1000 元

## （2）赎回费率

投资者在场内或场外赎回本基金份额时需交纳赎回费。

本基金的场外赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，同时区分普通客户赎回和通过直销柜台赎回的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括：

- 1) 全国社会保障基金；
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人届时将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，在招募说明书更新时对其进行更新，并按规定向中国证监会备案。

普通客户指除通过直销柜台赎回的养老金客户以外的其他客户。

普通客户场外赎回的具体费率如下：

持有期限 (N)	赎回费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 1 年	0.50%
1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0

注：上表中，1 年以 365 天计算。

普通客户场内赎回的具体费率如下：

持有期限 (N)	赎回费率
N < 7 日	1.50%
N ≥ 7 日	0.5%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。

对于普通客户而言，对持续持有期少于7日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日基金份额持有人，将不低于赎回费总金额的25%计入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

对于养老金客户而言，对持续持有期少于7日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期不少于7日的基金份额持有人设置特定赎回费率，特定赎回费率为原赎回费率的25%，收取的特定赎回费全额计入基金财产。

赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

(3) 转换费率

基金转换费用包括转换费和补差费：

1) 转换费率：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；

2) 补差费率

转换出基金	转换金额分段	转换入基金				
		融通巨潮 100 指数 (LOF)	融通领先成长混合 (LOF)	融通军工分级	证券分级	融通人工智能指数 (LOF)
融通四季添利债券 (LOF)	M<100 万	0.70%	0.70%	0.40%	0.40%	0.40%
	100 万≤M<200 万	0.70%	0.50%	0.10%	0.10%	0.10%
	200 万≤M<500 万	0.10%	0	0	0	0
	M≥500 万	0	0	0	0	0

转换出基金	转换金额分段	转换入基金
		融通四季添利债券 (LOF)
融通巨潮 100 指数 (LOF)	M<100 万	0
	100 万≤M<1000 万	0
	1000 万≤M<2000 万	0
	M≥2000 万	0
融通领先成长混合 (LOF)	M<100 万	0
	100 万≤M<200 万	0

	200万≤M<500万	0
	M≥500万	0
融通军工分级	M<100万	0
	100万≤M<200万	0
	200万≤M<500万	0.10%
	M≥500万	0
证券分级	M<100万	0
	100万≤M<200万	0
	200万≤M<500万	0.10%
	M≥500万	0
融通人工智能指数（LOF）	M<100万	0
	100万≤M<200万	0
	200万≤M<500万	0.10%
	M≥500万	0

目前参与本基金的转换业务的上述开放式基金的费率详见各相关基金最新招募说明书或公告的约定。

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒介上公告。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（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，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 5、申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

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

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）



申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

投资者通过场内申购的份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资者通过场外申购本基金 6,000.00 元，申购费率 0.80%，基金份额净值为 1.200 元，则其获得的基金份额计算如下：

净申购金额 =  $6,000.00 / (1 + 0.80\%) = 5,952.38$  元

申购费用 =  $6,000.00 - 5,952.38 = 47.62$  元

申购份额 =  $5,952.38 / 1.200 = 4,960.32$  份

即：投资者通过场外申购本基金 6,000.00 元，申购费率 0.80%，基金份额净值为 1.200 元，获得 4,960.32 份的基金份额。

如果投资者是通过场内申购，申购份额保留至整数份，故申购份额为 4,960 份，其余 0.32 份对应金额返回给投资者。

具体计算公式为：

实际净申购金额 =  $4,960 \times 1.200 = 5,952.00$  元

退款金额 =  $6,000 - 5,952.00 - 47.62 = 0.38$  元

即：投资者通过场内申购，申购份额为 4,960 份，其余 0.32 份对应金额返回给投资者，退款金额为 0.38 元。

## 6、赎回金额的计算

赎回金额计算方法如下：

赎回总金额 = 赎回份数 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例：假定 T 日本基金的基金份额净值为 1.200 元，某投资者（普通客户）赎回其持有的场外 10,000 份基金份额，持有期 15 个月，对应的赎回费率为 0.25%，则：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.200$  元 = 12,000.00 元

赎回费用 =  $12,000 \times 0.25\% = 30.00$  元

净赎回金额 =  $12,000 - 30 = 11,970.00$  元

即：某投资者（普通客户）赎回其持有的场外 10,000 份基金份额，持有期 15 个月，则其可得到的净赎回金额为 11,970.00 元。

例：假定 T 日本基金的基金份额净值为 1.213 元，某养老金客户赎回其持有的场外 10 万份基金份额，持有期限为 8 个月，原赎回费率 0.5%，养老金客户特定赎回费率为原赎回费率的 25%，对应的养老金客户赎回费率为 0.125%，则：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.213 = 121,300 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 121,300 \times 0.125\% = 151.63 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 121,300 - 151.63 = 121,148.37 \text{ 元}$$

即：养老金客户赎回 10 万份本基金场外份额，持有期限为 8 个月，假设赎回当日基金份额净值是 1.213 元，则其可得到的净赎回金额为 121,148.37 元。

## 7、转换份额的计算

转换份额计算方法如下：

$$\text{转换金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转换费} = \text{转换金额} \times \text{转换费率}$$

$$\text{补差费} = [(\text{转换金额} - \text{转换费}) / (1 + \text{补差费率})] \times \text{补差费率}$$

$$\text{转入份数} = (\text{转换金额} - \text{转换费} - \text{补差费}) / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

### （1）转入情况的计算

例：投资者转换 1 万份基金 X 至本基金，则其可得到转换入的本基金份额为：

基金 X 转出份额 10,000 份；

基金 X 转换申请日份额净值（NAV） 1.200 元；

本基金的份额净值（NAV） 1.000 元；

假设基金 X 转换至本基金份额的转换费率 0.5%，补差费率为 0.1%；

$$\text{转换金额} = 10,000 \times 1.200 = 12,000 \text{ 元；}$$

$$\text{转换费} = 12,000 \times 0.5\% = 60 \text{ 元；}$$

$$\text{补差费} = [(12,000 - 60) / (1 + 0.1\%)] \times 0.1\% = 11.93 \text{ 元；}$$

$$\text{转入份数} = (12,000 - 60 - 11.93) / 1.000 = 11,928.07 \text{ 份。}$$

即投资者转换 1 万份基金 X 至本基金，获得的本基金为 11,928.07 份。

注：由于转换基金所对应的费率不相同，上述示例仅作参考。

### （2）转出情况的计算

例：投资者转换 1 万份本基金至基金 X，则其可得到的转换入的基金 X 份额为：

本基金转出份额 10,000 份；

基金 X 转换申请日份额净值（NAV） 1.200 元；

本基金的份额净值（NAV） 1.000 元；

假设本基金转换至基金 X 的转换费率 0.5%，补差费率为 0.3%；

转换金额=10,000×1.000=10,000 元；

转换费=10,000×0.5%=50 元；

补差费=[(10,000-50)/(1+0.3%)]×0.3%=29.76 元；

转入基金 X 的份数=(10,000-50-29.76)/1.200=8,266.87 份。

即投资者转换 1 万份本基金至基金 X，获得基金 X 份额为 8,266.87 份。

注：由于转换基金所对应的费率不相同，上述示例仅作参考。

#### 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人的申购申请：

- （1）不可抗力的原因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收投资人的申购申请；
- （3）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （4）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的某笔申购。
- （6）基金管理人接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50%以上的。
- （7）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
- （8）当申购申请超过基金管理人设定的单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限的。
- （9）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）、（4）、（7）、（9）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，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。

## 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人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- （1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）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收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；
- （3）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （4）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- （5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
- （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投资人的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。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。对于场内赎回申请，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业务规则办理。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、拒绝或暂停转换的情形及处理方式

当转出基金暂停赎回，或转入基金暂停申购时，基金管理人暂停接受基金投资者的转换申请；当转入基金拒绝申购时，基金管理人拒绝接受基金投资者的转换申请。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定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。

在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额30%以上的赎回申请，可以全部自动进行延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（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

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

## 十二、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，基金管理人应及时向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒介及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒介及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净

值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒介及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

### 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。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。

### 十四、基金的转托管

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

#### 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）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赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）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上市交易的会员单位（交易单元）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### 2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管只限于在证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行，指投资者将基金份额在证券登记结算系统内某会员单位（交易单元）与注册登记系统内的某销售机构（网点）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。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

#### 十五、定期定额投资计划

本基金已于2014年3月3日起，开放通过直销机构及部分代理销售机构办理本基金的定期定额投资计划。具体详情请查看公司网站或相关公告。

#### 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。

## 第十部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制投资风险的基础上，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）、债券（包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、地方政府债券、次级债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、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的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场股票申购或增发股票，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

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

本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；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，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

### 三、投资理念

本基金强调通过债券组合优化配置策略，严格控制投资风险，追求长期、稳定的投资收益。

### 四、投资策略

#### 1、大类资产配置策略



本基金将在基金合同约定的投资范围内，采取稳健的一级资产配置。通过对宏观经济运行状况的研究，积极的调整和优化可转债、信用债等固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值；并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场首发新股和增发新股的申购，提高基金总体收益率。

## 2、固定收益类资产组合投资策略

本基金在债券组合构建过程中，具体的投资策略主要包括：利率策略、信用策略、可转债投资策略、资产支持证券等投资策略。

### （1）利率策略

利率策略指考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析。通过对宏观经济运行情况和对财政政策、货币政策的深入研究，形成对利率变化方向的预期，主动调整债券投资组合的久期。预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

### （2）信用策略

根据不同信用等级债券与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，并结合不同信用等级间债券在不同市场时期利差变化及收益率曲线变化，调整债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

本基金还将积极、有效的利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业发展周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素，综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

### （3）可转换债券的投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队及外部研究机构的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估，最终选择合适的投资品种。

### （4）资产支持证券等的投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支

持证券类资产。

### 3、股票申购策略

本基金将积极参与股票申购。本基金将积极利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和股票估值体系，分析首次发行股票及增发股票的上市公司基本面因素，再结合股票市场整体定价水平以及股票中签率等因素，判断股票上市交易的合理价格。充分发挥作为机构投资者在股票询价发行过程中的对股票定价所起的积极作用，积极参与股票询价及路演活动，有效识别并防范风险。同时参考一级市场资金利率成本，制定灵活的股票申购策略。

本基金对于通过参与股票认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定上市后继续持有或者卖出。

### 4、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 五、投资决策及投资操作程序

### （一）投资决策依据

- 1、须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- 2、以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
- 3、国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、政策指向及全球经济因素分析；

### （二）投资操作程序

投资决策委员会是公司投资方面最高层决策机构，定期就投资管理重大问题进行讨论，确定基金投资策略。

- 1、固定收益研究团队根据宏观经济形势和债券市场投资策略的研究结果，结合基金特点向投资决策委员会和基金经理提供债券投资策略和资产配置方案建议；
- 2、基金经理参考固定收益研究团队投资建议，拟定下一阶段基金投资债券配置方案，报投资决策委员会讨论；
- 3、投资决策委员会根据上报的投资策略建议和资产配置方案，进行久期决策并形成决

议；

4、根据投资决策委员会批准的资产配置决议，基金经理综合流动性、收益和久期策略构建资产组合和进行个券选择，并负责债券组合日常管理和动态优化；

5、债券交易员接受指令进行询价和反馈后达成交易，并且跟踪券款交割情况；

6、风险管理部负责完成基金内部业绩和风险评估，提交评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况，对上述管理程序作出调整。

## 六、投资限制

### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；
- （2）本基金投资于股票市值的比例不超过基金资产净值的 20%；
- （3）本基金投资于可转换债券市值的比例不超过基金资产净值的 30%；
- （4）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （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一家公司的发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （7）本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；
- （8）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%；
- （9）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，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- （10）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （11）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%；
- （12）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%；
- （13）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%；

（14）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；

（15）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；

（16）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%；

（17）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

（18）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列限制：

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，不得超过本基金资产净值的 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本基金持有的债券总市值的 30%；

3）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；

4）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%；

（19）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（20）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（21）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（22）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第（9）、（14）、（21）、（22）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的

投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

如果法律法规及监管政策等对本基金的基金合同所约定的投资组合比例限制进行变更，本基金在履行适当程序后可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行相关程序后不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）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；
- （6）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须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。

## 七、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中债综合指数收益率。

本基金属于债券基金，应采用债券指数作为业绩比较基准。“中债综合指数”是由中央国债登记结算公司于 2007 年 11 月 26 日发布。同其他已发布的中债指数相比，中债综合指数有以下几个主要特点：

- 1、样本债券涵盖的范围更加全面，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限的债券，是中国目前最权威、应用最广的债券指数之一。从债券类别看，除了美元债、资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外，其他所有债券，包

括固定债和浮动债，含权债和不含权债均纳入样本债券范围。从债券待偿期来看，待偿期在一年以内的债券也进入指数样本券集，中债综合指数中一年以下待偿期分段子指数可视为短债总指数。

2、各项指标值的时间序列更加完整。特别是全价和净价指数序列及其涨跌幅和平均市值法到期收益率等一系列指标均从2002年1月4日开始，长周期时间序列有利于更加深入地研究和分析市场。

3、由于样本债券涵盖的范围广，中债综合指数可以作为一个最具一般性的业绩比较基准。

中债综合指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映了债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

## 八、风险收益特征

本基金属于债券基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

## 九、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 十、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十一、基金流动性管理的措施

### （一）信用类债券流动性管理

债券的信用等级高低与其流动性好坏有着正向的相关性，因此本基金投资信用类债券的信用等级控制也是流动性管理的重要一环。

本基金在参照债券发行人的第三方信用评级同时，利用“融通信用债券评级系统”对债券发行人进行严格的财务分析和偿债能力分析并进行等级评分。在达到相关信用评级条件后，按照相关流程进入公司信用债券投资库，并对投资库品种进行后期跟踪维护和动态管理。

严格的信用债投资库管理可以最大可能的保障投资信用债券的资质，有效规避信用风险，同时也是保证债券流动性的重要前提。

## （二）投资流通受限证券流动性管理

本基金对投资流通受限证券的严格比例限制，可以有效防范流通受限证券对基金可能带来的流动性风险和投资比例超过相关法规的风险。

## （三）季季分红对基金投资的流动性影响

本基金使用三种方式保证分红的流动性要求，一是以融资回购的方式保证流动性；二是卖出部分短期信用债券保证分红流动性；三是卖出部分流动性较好的非信用债券，如国债和央票。

## 十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于2019年4月3日复核了本报告的内容，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2018年12月31日。

### 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	14,831,892.95	1.18
	其中：股票	14,831,892.95	1.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,211,565,672.41	96.61
	其中：债券	1,211,565,672.41	96.61
	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	-	-
	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	3,308,389.48	0.26
8	其他资产	24,419,083.38	1.95
9	合计	1,254,125,038.22	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
---	------	---------	-----------

码			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,729,081.60	1.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,102,811.35	0.56
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,831,892.95	1.63

### 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	000903	云内动力	4,053,784	9,729,081.60	1.07
2	002344	海宁皮城	1,121,497	5,102,811.35	0.56

### 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	36,812,517.60	4.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	274,572,000.00	30.20
	其中：政策性金融债	274,572,000.00	30.20
4	企业债券	574,275,633.49	63.16
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	325,253,000.00	35.77
7	可转债（可交换债）	652,521.32	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	1,211,565,672.41	133.24
----	----	------------------	--------

## 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	180406	18农发06	2,100,000	224,553,000.00	24.70
2	143483	18京资02	500,000	53,015,000.00	5.83
3	1805114	18新疆债06	500,000	52,180,000.00	5.74
4	101800662	18京能源MTN001	500,000	52,110,000.00	5.73
5	143737	18远海03	500,000	50,955,000.00	5.60

## 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国债期货交易情况说明

## 9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 9.2 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。

## 9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10. 投资组合报告附注

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,842.00
2	应收证券清算款	288,436.32
3	应收股利	-
4	应收利息	23,828,042.82

5	应收申购款	273,762.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,419,083.38

## 10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	220,527.00	0.02

## 10.5 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	002344	海宁皮城	5,102,811.35	0.56	流通受限

## 第十一部分 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。

基金合同生效日 2012 年 3 月 1 日，基金业绩截止日为 2018 年 12 月 31 日。

基金合同生效以来本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

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
2012年3月1日（基金合同生效日）至2012年12月31日	5.96%	0.07%	0.27%	0.06%	5.69%	0.01%
2013年度	0.92%	0.09%	-3.75%	0.08%	4.67%	0.01%
2014年度	13.72%	0.16%	6.54%	0.11%	7.18%	0.05%
2015年度	8.47%	0.15%	4.18%	0.08%	4.29%	0.07%
2016年度	4.44%	0.10%	-1.63%	0.09%	6.07%	0.01%
2017年度	1.06%	0.07%	-3.38%	0.06%	4.44%	0.01%
2018年度	8.88%	0.13%	4.79%	0.07%	4.09%	0.06%

## 第十二部分 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

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。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注册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、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册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消；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消。

### 第十三部分 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、债券、权证、国债期货合约和银行存款本息等资产和负债。

#### 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，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）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（法律法规另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

##### 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）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

（4）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、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

#### 4、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5、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。

#### 6、同业存单的估值方法

同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

#### 7、投资证券衍生品的估值方法

（1）从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。

（2）首次发行未上市的权证，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）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（4）国债期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

8、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

9、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。

10、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。

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，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。

#### 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，基金份额净值均精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人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3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

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、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 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 0.50%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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商确认的；

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 9 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、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益分配

### 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

本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的份额净值自动转为基金份额进行再投资；选择红利再投资方式的投资者其红利所转换的基金份额免收申购费用；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

登记在证券登记结算系统中的基金份额只能采取现金红利的分配方式，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（2）基金收益分配基准日的基金份额净值减去每份基金份额收益分配金额后不能低于初始面值；

（3）每份基金份额享有同等分配权；

（4）在满足以上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低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 50%；

（5）若截至每季度末，每份基金份额的可供分配利润大于 0.02 元且没有进行过当季度的收益分配（以收益分配基准日所在期间为准），则应于该季度结束后 15 个工作日内就此可供分配利润实施收益分配；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 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，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册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。

## 第十五部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的上市费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十六部分 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；
- 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和基金托管人同意。

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日内在至少一家指定媒介及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 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。

### 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。

#### （二）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金上市日前至少3个工作日，将基金上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### （三）基金资产净值、基金份额净值

1、《基金合同》生效后，基金上市交易前，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。

2、基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

3、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将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。

4、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。

#### （四）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销售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （五）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和基金管理人网站上。

《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和书面报告方式。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （六）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；
- 8、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 9、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；
- 10、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- 11、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 12、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；
- 13、重大关联交易事项；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、基金改聘会计师事务所；
- 18、变更基金销售机构；
- 19、更换基金注册登记机构；
- 20、本基金开始办理申购、赎回；
- 21、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 22、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 23、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 24、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 25、基金暂停上市、恢复上市、终止上市；
- 26、本基金发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

#### （七）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。

#### （八）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。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （九）国债期货的投资情况

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）资产支持证券的投资情况

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）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和基金管理人网站上披露信息外，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和基金管理人网站披露信息，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

### 一、市场风险

基金主要投资于证券市场，证券市场价格会因经济因素、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，导致基金收益水平和净值发生变化，从而给基金投资人带来风险。证券市场风险主要包括：

#### 1、政策风险

政策风险是指有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的法规、举措出台，引起证券市场的波动，从而给投资人带来风险。

#### 2、经济周期风险

经济周期风险是指证券市场行情周期性变动而引起的风险，这种行情变动不是指证券价格的日常波动和中级波动，而是指证券行情长期趋势的改变。

#### 3、利率风险

利率风险是指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。

#### 4、购买力风险

购买力风险又称通货膨胀风险，是指由于通货膨胀、货币贬值给投资人带来实际收益水平下降的风险。

#### 5、信用风险

信用风险又称违约风险，是指证券发行人在证券到期时无法还本付息而使投资人遭受损失的风险。

#### 6、公司经营风险

公司经营风险是指公司的决策人员与管理人员在经营管理过程中出现失误而导致公司盈利水平变化，从而使投资人预期收益下降的可能。

#### 7、财务风险

财务风险是指公司财务结构不合理、融资不当而导致投资人预期收益下降的风险。

#### 8、流动性风险

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，从而产生流动性风险。

### ①拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于债券市场，本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，且本基金通过严格的债券投资库管理，最大可能的保障投资债券的资质，能有效规避信用风险，同时也有效保证了债券的流动性。本基金投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；且本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%，通过对流通受限证券投资比例的限制，降低投资组合的流动性风险。

综上所述，本基金拟投资市场及资产的流动性风险相对可控。

### ②巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，对于在开放日单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 30%以上的赎回申请，基金管理人可以全部自动进行延期办理。

### ③实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者潜在的影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

## 二、管理风险

基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素而影响收益水平。

## 三、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况时，可能导致基金日常的申购或赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示基金净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## 四、巨额赎回风险

若因市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人出现现金支付困

难时，基金份额持有人申请赎回基金份额可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

## 五、本基金特定风险

1、在法律法规允许的情况下，本基金可参与一级市场股票申购或增发股票，以提高基金预期收益水平，但通过一级市场股票申购或增发股票获得的股票，在其流通受限期间无法上市交易，存在流动性风险。

2、本基金份额可上市交易，交易价格与基金份额净值之间可能发生偏离，即出现溢价交易或者折价交易的风险。基金份额上市交易后，也可能规模较小或者交易量不足，导致投资者不能迅速卖出、低成本卖出或者买入的风险。

3、本基金可以投资于国债期货，经济周期变化、市场利率波动、缺乏合约交易对手等因素都会影响国债期货市场，因此本基金还需要承担期货市场的系统性风险和价格波动风险。

4、本基金可投资于资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

## （六）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产面临遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## 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、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）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规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、委托、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注册登记机构办理基金注册登记业务并  
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）在符合有关法律规法规和《基金合同》的前提下，决定和调整除调高管理费率  
和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- （13）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；
- （14）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；
- （15）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；
- （16）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外  
部机构；

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；如认为基金销售机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议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；

（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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

（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）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（25）建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

（26）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收入；

（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）以基金托管人和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和深圳

分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《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) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行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，应为基金利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人的权利与义务**

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

- 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
- (1) 分享基金财产收益；
  - (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
  - (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
  - (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
  - (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
  - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
  - (7) 监督基金管理人的投资运作；
  - (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及销售机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 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。

### （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》；
- (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（但根据法律法规的要求调整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) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 终止基金上市，但因本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；

(13) 对基金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》规定的范围内调整本基金的申购费率、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变化；

(5) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当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、基金份额持有人大会未设立日常机构的，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、基金份额持有人大会未设立日常机构的，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、基金份额持有人大会设立日常机构的，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向该日常机构提出书面提议。该日常机构应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金管理人、基金托管人和提出提议的基金份额持有人代表。该日常机构决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；该日常机构决定不召集，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，按照未设立日常机构的相关规定执行。

6、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，而基金份额持有人大会的日常机构（如设）、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。

7、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、监管机构允许的其他方式召开，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利，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）。

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止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；

（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亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用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。

### （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。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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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、《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、争议解决方式**

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

#### （一）基金管理人

名称：融通基金管理有限公司

住所：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

法定代表人：高峰

成立时间：2001 年 5 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2001]8 号

注册资本：12500 万元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：发起设立基金，基金管理

存续期间：持续经营

电话：（0755）26947517

传真：（0755）26935011

联系人：赖亮亮

#### （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：

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）、债券（包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、地方政府债券、次级债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、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的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场股票申购或增发股票，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

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

本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；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，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；
- （2）本基金投资于股票市值的比例不超过基金资产净值的 20%；
- （3）本基金投资于可转换债券市值的比例不超过基金资产净值的 30%；
- （4）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；



- （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并由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%；
- （7）基金管理人管理的并由基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；
- （8）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%；
- （9）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，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- （10）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （11）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%；
- （12）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%；
- （13）本基金管理人管理的并由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%；
- （14）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；
- （15）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；
- （16）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%；
- （17）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；
- （18）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列限制：
  - 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，不得超过本基金资产净值的 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本基金持有的债券总市值的 30%；
  - 3）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；
  - 4）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%；

（19）本基金管理人管理的并由基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（20）本基金管理人管理的并由基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（21）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（22）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

如果法律法规及监管政策等对本基金的基金合同所约定的投资组合比例限制进行变更，本基金在履行适当程序后可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行相关程序后不再受相关限制。

除上述第（9）、（14）、（21）、（22）项另有约定外，由于证券市场波动、上市公司合并或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，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。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）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事可能使基金承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但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；
- （6）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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。基金管理人负责保管真实、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。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) 基金管理人应按照基金托管人确定的文件格式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。基金托管人根据名单对基金管理人银行间市场交易进行监督。基金管理人拟增加或减少银行间市场交易对手的，应按照前述要求重新向基金托管人提交名单，并通过电话或邮件向基金托管人确认，拟调整名单经基金托管人确认后开始生效。因基金管理人未履行确认程序导致交易对手名单未变更的，基金托管人不承担责任。基金管理人知晓并同意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) 基金管理人未提供交易对手名单或交易对手名单文件格式不符合托管人要求的，均视为未提供名单。基金管理人同意，基金托管人无需履行前款项下监督职责。因此给基金造成的损失由基金管理人承担。

基金管理人未提供交易对手名单，但基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，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。

(3) 基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以DVP(券款兑付)的交易

结算方式进行交易。

#### 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。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此自行选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

#### 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）基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，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》、基金托管协议及其他有关规定时，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。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反有关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。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，及时通知基金管理人，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、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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、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，并予以协助配合。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和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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。

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具有托管资格的商业银行开设的融通基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。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。

该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。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国债市场回购主协议，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当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、基金资产净值计算和复核

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

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3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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办法》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。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，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予以公布。

#### （二）基金资产估值方法

##### 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、国债期货合约和银行存款本息等资产及负债。

##### 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，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在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（法律法规另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

③对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

④对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

（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对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

④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）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（4）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

（5）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。

（6）同业存单的估值方法

同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

（7）投资证券衍生品的估值方法

①从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。

②首次发行未上市的权证，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因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

④国债期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

（8）当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

（9）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。

（10）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。

由于证券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。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表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注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应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。保管期限为15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

双方当事人同意，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，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对双方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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、基金托管协议的变更、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。

#### 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) 基金清算组做出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算公告；
- (9) 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。

### 8、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，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、客户服务中心电话服务

持有人拨打基金管理人客服热线 400-883-8088（国内免长途话费）、0755-26948088 可享有如下服务：

A、自助语音服务：提供 7×24 小时电话自助语音服务，可进行账户查询、基金净值、信息定制等自助服务。

B、人工坐席服务：提供工作日人工坐席服务（法定节假日除外）。持有人可以通过该热线获得业务咨询、账户查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

### 二、综合对账单服务

基金管理人为基金份额持有人提供综合对账单服务，服务形式包括网站自助查询、电子邮件账单、手机短信账单、客服热线查询、纸质对账单邮寄等。其中，纸质对账单邮寄仅限给已定制纸质对账单的持有人邮寄。

### 三、网站自助服务

基金管理人网站(www.rtfund.com)为持有人提供基金账户及交易情况查询、资料修改、手机短信和电子邮件信息定制等自助服务，提供公司公告、热点问答、市场评述等资讯服务。同时，网站还设有电子邮箱服务（客户服务邮箱：service@mail.rtfund.com）。

### 四、网上交易服务

基金管理人提供开放式基金网上直销服务。投资者通过基金管理人网站 www.rtfund.com 可以办理基金认购、申购、赎回、转换、撤单、基金定投、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易情况查询、积分查询和账户信息查询等各类业务。

### 五、客户投诉建议受理服务

持有人可以通过基金管理人客服热线、网站、电子邮件及信函等渠道进行投诉或提出建议。对于工作日受理的投诉，原则上当日答复，当日未能答复的，我们也会在当日将处理进展情况及时告知持有人。

### 六、联系方式

1、融通基金管理有限公司客户服务热线：

400-883-8088（国内免长途电话费）、0755-26948088

2、融通基金管理有限公司互联网站

网址：<http://www.rtfund.com>

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

3、客户服务传真：0755-26948079

4、邮寄地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13楼融通基金管理有限公司客户服务中心  
（邮编：518053）。

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。



## 第二十三部分 其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加东北证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-09-05
2	关于中国国际金融股份有限公司代销的融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增开通定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-09-14
3	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-09-29
4	融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）第二十九次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-10-15
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-11-15
6	融通基金关于新增大连网金基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-12-24
7	融通基金关于继续参加北京蛋卷基金销售有限公司开展的前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-12-28
8	关于融通旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司 2019 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-12-28
9	融通基金关于继续参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司开展的前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-12-28
10	融通旗下部分开放式基金继续参加上海基煜开展的前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018-12-28
11	融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）第三十次分红公告	中国证券报、管理人网站	2019-01-14
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国信证券股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2019-01-15
13	融通基金管理有限公司关于融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)调整大额申购限制金	中国证券报、管理人网站	2019-01-21

	额的公告		
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金 新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2019-01-26
15	融通关于旗下部分开放式基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2019-01-30

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

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；也可按工本费购买本招募说明书复印件。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管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、中国证监会准予本基金变更注册的文件
- 2、《融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

### 二、备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。