

华安全球美元票息债券型证券投资基金  
更新的招募说明书  
(2021 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二一年三月五日

## 重要提示

华安全球美元票息债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会2016年1月21日证监许可[2016]149号文核准。本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过指定媒介进行了公开披露。本基金的基金合同自2016年6月3日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的投资价值及市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金可投资于境内外证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险等。本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。

但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见基金管理人网站公示名单。

本基金A类份额采用人民币和美元发售，目前C类份额仅采用人民币发售。本基金人民币基金份额发售面值为人民币1.00元。美元份额发售面值为1.00元人民币按基金募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算的美元金额。在本基金存续期间，基金管理人不承担基金销售、基金投资等运作环节中的任何汇率变动风险。

在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于发售面值。

投资者可使用人民币或美元提交本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元份额。

本招募说明书中涉及托管业务的相关内容已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书其他所载内容截止日为2021年3月5日，有关财务数据表现截止日为2020年12月31日，净值表现截止日为2020年6月30日。

# 目录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、风险揭示 .....	8
四、基金的投资 .....	17
五、基金的业绩 .....	33
六、基金管理人 .....	35
七、基金的募集 .....	46
八、基金合同的生效 .....	47
九、基金份额的申购、赎回.....	48
十 基金的费用与税收.....	62
十一、基金的财产 .....	65
十二、基金资产的估值.....	67
十三、基金的收益与分配.....	74
十四、基金的会计与审计.....	76
十五、基金的信息披露.....	77
十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	84
十七、基金托管人 .....	87
十八、境外托管人 .....	90
十九、相关服务机构 .....	91
二十、基金合同的内容摘要.....	119
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	120
二十二、对基金投资人的服务.....	121

二十三、其他应披露事项.....	123
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	129
二十五、备查文件 .....	130
附件一：基金合同内容摘要.....	131
附件二：托管协议内容摘要.....	148

## 一、绪言

《华安全球美元票息债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《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》”）及其他有关规定以及《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

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

## 二、释义

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：指华安全球美元票息债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指华安基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
- 5、基金合同、《基金合同》：指《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华安全球美元票息债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《华安全球美元票息债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、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
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《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
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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

13、《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

14、《试行办法》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《通知》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日公布、自同年 7 月 5 日起实施的《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订

16、《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

17、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、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

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

20、外管局：指国家外汇管理局或其授权的代表机构

21、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

22、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

23、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

24、合格境外机构投资者：指符合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

25、投资人或投资者：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（以人民币、美元）购买证券投资基金（相应币种份额）的其他投资人的合称

26、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

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

28、销售机构：指华安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，代为办理基金销售业务的机构

29、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

30、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华安基金管理有限公司或接受华安基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

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

35、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的

开放日

39、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数

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。上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日为本基金的开放日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外

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

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

44、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

45、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

46、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

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

48、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理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、基准货币：指基金资产估值的记账本位币。本基金的基准货币为人民币

51、人民币：指中国法定货币

52、美元：指美国法定货币及法定货币单位

53、元：指人民币元

54、基金份额类别：指本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类；不收取前后端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类。在A类份额内，根据认购、申购、赎回计价币种的不同，分为人民币份额和美元份额

55、汇率：如无特指，指中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价

56、基金收益：本基金合同项下的基金收益即为基金利润，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

57、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

59、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得出的基金份额财产净值。本基金人民币份额的基金份额净值为计算日基金资产净值除以基金份额总数；本基金美元份额的基金份额净值为计算日人民币基金份额净值按中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算的美元金额

60、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

61、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

62、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

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

64、境外：指包括香港特别行政区、澳门特别行政区以及台湾地区在内的中华人民共和国领土之外的国家、地区

65、基金产品资料概要：指《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。关于基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行

### 三、风险揭示

本基金主要投资于境内外证券。证券价格可能会因为国际政治环境、宏观与微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险。

#### （一）投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

##### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于股票与债券资产市场价格的波动。影响股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素：

#### （1）政治动荡风险

政治动荡风险是指本基金所投资的国家或地区出现政变或暴乱等政治事件，影响到该国家或地区的经济发展，进而影响到本基金所持有的证券价格，给本基金的收益带来负面影响。

#### （2）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### （3）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于上市公司的股票与债券，其收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

#### （4）利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票与债券，其收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。

#### （5）通货膨胀风险

基金份额持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### (6) 汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响,从而导致本基金所投资的上市公司业绩及其股票价格。

#### (7) 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使基金投资收益下降。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险,但并不能完全消除该种风险。

#### (8) 债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险,单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### (9) 再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率,这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### 2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### 3、流动性风险评估及流动性风险管理工具

因市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资人大额赎回,致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### (1) 基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第九部分 基金份额的申购与赎回”章节。

#### (2) 本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1) 本基金投资于境内境外市场。基金合同约定:“针对境内投资,本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具”,“针对境外投资,本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、

全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外融工具”，其中“投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%”，从投资范围上看，基金资产的流动性良好；

2) 从投资限制上看，基金合同约定：“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- 1) 暂停接受赎回申请；
- 2) 延缓支付赎回款项；
- 3) 延期办理；
- 4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见招募说明书“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
 基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申

请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

1) 暂停接受赎回申请

具体措施，详见招募说明书“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

2) 延缓支付赎回款项或延期办理

上述具体措施，详见招募说明书“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

4) 暂停基金估值

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，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

5) 中国证监会认定的其他措施。

(二) 境外投资风险

1、海外市场风险

由于本基金主要投资于境外证券，因此不同国家和地区所处的不同产业景气循环周期位置、实施的不同宏观经济政策（财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等），将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场的市场机制、运行规律、波动性以及对于特定事件、特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反应较国内 A 股证券市场有诸多不同，可能存在市场流动性不足、价格波动大、通货膨胀和通货紧缩、利率变动等风险。比如，美国、英国、香港等证券市场对于每日证券交易价格没有涨跌幅上下限的规定，因此每日价格涨跌空间相对较大，市场波动性高。所有这些因素加上时间和空间的差异使得在实际运作过程中，境外投资的市场风险比国内市场风险更难控制。

2、汇率风险



本基金主要投资于全球市场以外币计价的金融工具。外币相对于人民币的汇率变化可能会影响本基金的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。

本基金 A 类份额采用人民币和美元销售。美元份额发售价格为 1.00 元除以募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价，并以此计算投资者最终以美元认购的基金份额，投资者需承担募集期内的美元汇率波动的风险。美元申购赎回价格为按照相应基金份额净值除以中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价计算的美元折算净值，由于存在汇率波动，可能导致以美元计算的收益率和以人民币计算的收益率有所差异。

此外，由于汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

投资者使用人民币申购本基金，本基金将人民币兑换为外币在海外市场投资。

为了有效地管理投资组合，本基金将在不抵触基金的投资策略及投资限制的情况下，利用远期合约以及其他经中国证监会认可的金融衍生产品以避免币值波动而影响本基金投资收益。

### 3、政府管制风险

所谓政府管制，是指政府部门通过制定规章、设定许可、监督检查、行政处罚和行政裁决等行政处理行为，对社会经济行为实施直接控制。在境外证券投资过程中，投资地所在国家或地区政府部门可能针对本基金实施投资运作、交易结算以及资金汇出入等方面的限制，或者采取资产冻结或扣押等行政措施，从而造成相应的财产受损、交易延误等相关风险。

### 4、政治风险

国家或地区的政治政策、财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，也会产生风险，称之为政治风险。例如，国内政治斗争变革风险、外汇资金流动和汇兑限制的外汇管制风险；新政府或许会拒绝承担前任政府的债务。

### 5、国家风险

由于本基金投资于海外不同国家的市场，而这些投资受到各国汇率、税法、政府政策、对外贸易、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的变化可能会使基金的资产面临潜在风险。此外，境外投资的成本、境外市场

的波动性均可能会高于本国市场，也存在一定风险。

#### 6、初级产品风险

本基金不直接投资于钢材、石油、煤炭、有色金属等初级产品，但上述初级产品价格的不利变化可能对本基金部分投资标的带来负面影响，从而对本基金参与相关证券投资的收益带来间接的影响。

#### 7、小市值/高科技公司股票风险

对于小市值股票而言，由于上市公司发展模式、管理能力尚未成熟，相对于大型蓝筹股而言，其二级市场价格波动性更大，有可能给投资者带来损失。

小市值公司股票存在流动性风险，高科技公司股票也可能存在技术风险和产  
品风险。

#### 8、税务风险

在投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。各国、地区的税收法律法规的规定可能发生变化，或者进行具有追溯力的修订，所以本基金可能须向该等国家或地区缴纳基金销售、估值或者出售投资当日并未预计到的额外税项。

#### 9、交易结算风险

国际结算的支付方式和时间的差异可能造成划付款项的延误和错划，进而影响到投资者的申购赎回及基金资产的安全。

### （三）管理风险

#### 1、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能符合基金合同的要求，不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

#### 2、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险，如经常性的串户，帐务记重，透支、过失付款，资金汇划系统款项错划，日终轧帐

假平，会计备份数据丢失，利息计算错误等。

通过双会计制以及基金会计核算、托管方会计复核的方法可以有效控制会计核算风险。

### 3、金融模型风险

基金管理者对风险的管理越来越依赖复杂的量化模型，于是衍生出模型风险。模型风险是指由于应用了不恰当的模型、或虽使用了恰当的模型但是模型的结构不够充分、或者夸大了模型的解释能力，由此导致金融机构的信誉恶化或获利能力降低。我们可以把模型风险产生的原因归结为五个方面：①由于给定模型的随机特性，模型中有内在的不确定性。②将具有特定结构和参数估计的模型运用于某种特殊的环境中。③在给定的模型中，参数赋值的不确定性。用统计方法估计的参数值错误的可能性很大，如果用于模型中进行预测，预测值就极有可能是错误的。④模型选择错误。⑤金融模型通常建立在一系列的学术假设之上，投资实践与学术假设之间存在一定的差距。

### 4、证券借贷/回购风险

证券借贷/回购风险是指基金为实现有效资产管理而进行证券借贷、正回购或逆回购时发生的风险因素，如交易对手风险、借贷或回购利率风险、资产流动性风险、杠杆效应等，可能导致偏离投资目标。

本基金将杜绝投机操作，在严格控制交易对手风险、利率风险和资产流动性风险的前提下，谨慎进行证券借贷和回购交易。

### 5、大宗交易风险

大宗交易风险是指基金为提升交易效率或实现特定投资目的而进行大宗交易时发生的风险因素，如交易对手风险、相关资产法律风险等，可能导致基金资产损失或陷入法律纠纷。

本基金将在严格控制交易对手风险、法律风险的前提下，谨慎进行大宗交易

### 6、新产品创新带来的风险

随着中国证券市场与国际市场的接轨，各种国外的投资工具也逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产保值增值的同时，也会产生一些新的投资风险，例如可转换债券带来的转股风险，利率期货带来的期货投资风险等。同时，基金管

理人可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

#### （四）合规性风险

指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

#### （五）操作风险

基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

#### （六）其他风险

##### 1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。

##### 2、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，可能导致基金日常的申购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产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

##### 3、大额赎回风险

本基金是一开放式基金，基金规模将随着投资人对基金份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售债券和股票以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

##### 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

##### 5、第三方风险

第三方风险是指本基金运作的当事人，如：基金管理人、投资顾问、基金托管人和经纪商等，在合作中自身没有过错，但是当事人委托的或无任何关系的第三方的作为可能影响到当事人，并且进一步影响到基金的收益。

#### 6、其他不可抗力风险

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

#### 声明：

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售机构销售。但是，本基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 四、基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严谨信用分析的基础上,通过分析来自全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻求各类债券的投资机会。力争在严格控制风险的前提下,同时追求获取超越业绩比较基准的投资收益。

### 二、投资范围

本基金投资于境内境外市场。

针对境内投资,本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票),权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具。

针对境外投资,本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括ETF);与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外融工具。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的20%,现金或者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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制。

### 三、投资策略

#### 1、国家/地区配置策略

本基金将根据对全球市场经济发展的判断，以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。

#### 2、债券类属配置策略

本基金将基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断，根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略，并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效把握经济不同发展阶段的投资机会，实现基金资产的保值增值。

不同经济周期下，本基金调整投资的投资等级债券和高收益债券的比例。投资等级债券是指经国际主要评等机构（如标准普尔、穆迪及惠誉等）评为投资等级的政府债券、公司债以及其他固定收益品种（如房地产抵押债券、金融抵押债券等）；高收益债券是指经国际主要评等机构评为非投资等级公司债，如未达到 S&P 评级 BBB- 级的债券，或未达到 Moody' s 评级 Baa3 级，或未达到 Fitch 评级 BBB- 级的债券。

#### 3、利率类品种投资策略

本基金对利率品种的投资，是在对经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，同时结合基金的现金流预测调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。具体的利率品种投资策略如下：

##### （1）目标久期策略

基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定债券组合平均剩余期限。如果预测未来利率将上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险；相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额回报。

#### （2）收益率曲线策略

在目标久期确定的基础上，通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合期限结构策略（主要包括子弹式策略、两极策略和梯式策略），在短期、中期、长期债券间进行配置，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。其中，子弹式策略是使投资组合中债券的到期期限集中于收益率曲线的一点；两极策略是将组合中债券的到期期限集中于两极；而梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

#### （3）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，基金可获得较高的资本利得收入。

#### （4）利差套利策略

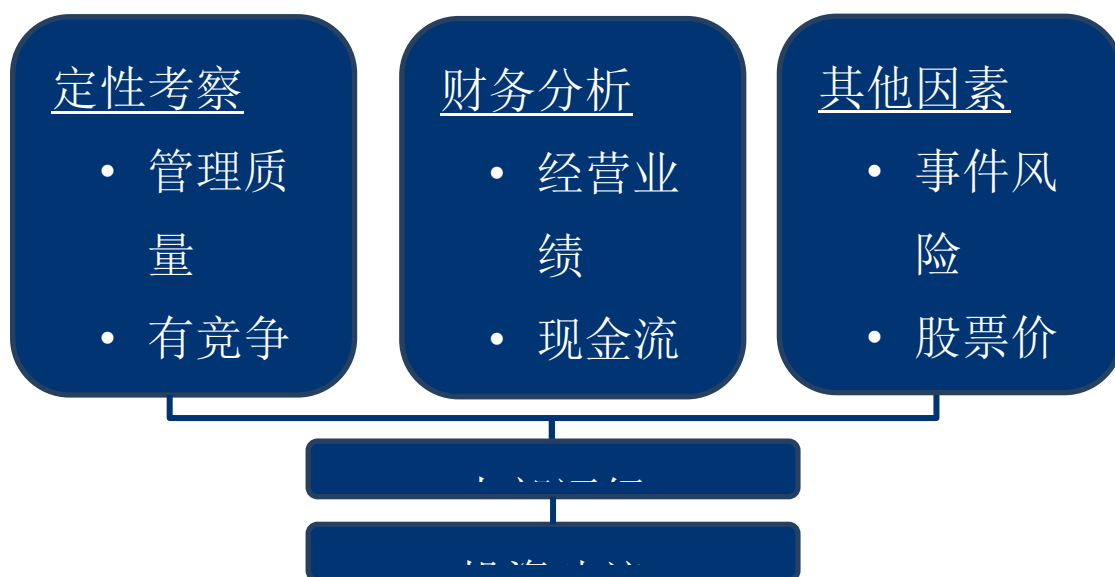
利差套利策略主要是指利用负债和资产之间收益率水平之间利差，实行滚动套利的策略。只要收益率曲线处于正常形态下，长期利率总要高于短期利率。由于基金所持有的债券资产期限通常要长于回购负债的期限，因此可以采用长期债券和短期回购相结合，获取债券票息收益和回购利率成本之间的利差。在制度允许的情况下，还可以对回购进行滚动操作，较长期的维持回购放大的负债杠杆，持续获得利差收益。回购放大的杠杆比例根据市场利率水平、收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期进行调整，保持利差水平维持在合理的范围，并控制杠杆放大的风险。

### 4、信用债投资策略

本基金将投资信用债，主要在信用分析的基础上采用买入并持有的投资策略，并综合期限机构、互换等债券投资策略。

#### （1）信用分析策略





### (2) 买入持有策略

买入期限适中的债券，并持有到期，或者是持有回售期与预期期限相匹配的债券，获得本金和票息收入；同时，根据所持债券信用状况变化，进行必要的动态调整；此外，本基金通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益；同时，本基金也坚持控制单只债券资产占组合净值的比例上限，以达到风险分散的目的。

### (3) 信用利差曲线变化策略

通过分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，以及分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

### (4) 信用债信用变化策略

发行人信用发生变化后，将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。本基金管理人主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差；此外，也利用阶段性信用事件造成的整体信用风险溢价上升，寻找错杀品种，获取超额收益。

## 5、基金投资策略

本基金的基金投资主要对象为债券基金等固定收益类基金。

**封闭式基金：**封闭式基金由于份额固定，可直接体现投资管理人的持续管理能力。本基金对封闭式基金的选择要素：（1）考察封闭式基金的投资管理能力，

选择持续投资管理能力卓越的基金，享受因其净值变化而导致价格变化所带来的收益；（2）考察基金折价率的变动，在其他条件相当的情况下，选择折价率高的基金，享受基金折价率向市场平均水平方向变动带来的收益。

开放式基金：对债券型基金考察其久期配置和信用配置能力，利用模型精确刻画基金投资行为，根据各指标贡献度综合基金排名，精选成立历史较长，规模大，品牌好的基金公司，资产管理能力优异的基金作为投资的对象，以争取获得长期、稳定且丰厚的投资回报。

#### 6、汇率避险策略

紧密跟踪汇率动向，通过对各国/地区的宏观经济形势、货币政策、市场环境以及其他可能影响汇率走势的因素进行深入分析，并结合相关外汇研究机构的成果，研判主要汇率走势，并适度进行外汇远期、期货、期权等汇率衍生品投资，以降低外汇风险。

#### 7、其他金融衍生品投资

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资；可能使用到的衍生产品包含货币远期/期货/互换、利率互换、信用违约互换及相关指数等可以进行宏观和微观风险对冲的工具。衍生品投资的策略包括利用指数衍生品，降低基金的市场整体风险等。

本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品，当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时，在严格风险控制的前提下，本基金将采用场外交易市场（OTC）买卖衍生产品。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%；

（2）本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低

于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(4) 本基金境内投资的，还须遵循以下限制：

(a) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）；本基金管理人管理的全部开放式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%；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%；

(b) 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%；

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

(d) 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%；

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

(f) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(j) 基金财产参与境内股票发行申购，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；

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

(l) 本基金的其他境内投资限制根据相关法律法规及中国证监会规定和基金合同约定进行限制；

(m) 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；

(5) 本基金境外投资的，还须遵循以下限制：

(a) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中境外投资中，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

(b) 本基金持有同一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）不得超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有同一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）；

(c) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

(d) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(e) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制；

(f) 本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(g) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产

净值的 10%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准；

(h) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(6) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。若基金超过上述除第 (2)、(3) 项以外的投资比例限制，针对境内投资部分，除上述第 (i)、(m) 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定，从其规定。针对境外投资部分，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合投资比例限制要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金境内投资不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 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。

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金境外投资禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (14) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (15) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务，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。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### 3、金融衍生品投资

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，投资于境外金融衍生品的，同时应当严格遵守下列规定：

- (1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

(2) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

4、本基金可以参与境外证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

1) 现金；

2) 存款证明；

3) 商业票据；

4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责

任。

5、基金可以根据正常市场惯例参与境外正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6、基金参与境外证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准 = 95% × 巴克莱资本美国综合债券指数收益率 + 5% × 商业银行税后活期存款基准利率

由于本基金以全球各国家和地区的美元债券为主要投资标的，现金或者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%。因此选择本基金的业绩比较基准为：95% × 巴克莱资本美国综合债券指数收益率 + 5% × 商业银行税后活期存款基准利率。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是



市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。

本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、金的投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 12 月 31 日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产
----	----	----------	--------

			产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	92,121,839.83	85.19
	其中：债券	92,121,839.83	85.19
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,532,077.10	13.44
8	其他资产	1,487,679.34	1.38
9	合计	108,141,596.27	100.00

## 2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

#### 4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

#### 5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
A+至 A-	0.00	0.00
BBB+至 BBB-	23,452,930.93	22.22
BB+至 BB-	37,139,267.55	35.18
B+至 B-	31,529,641.35	29.87
未评级	0.00	0.00

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

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

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	XS2125922 349	BANK OF CHINA	3,914,940	3,982,433.5 7	3.77
2	XS1684793 018	POSTAL SAVINGS BK CHINA	3,262,450	3,352,167.3 8	3.18
3	XS2235973 943	HUARONG FINANCE 2019	3,262,450	3,350,209.9 1	3.17
4	XS2229473 678	IND & COMM BK	3,262,450	3,320,586.8 6	3.15

		OF CHINA			
5	XS2238561 281	BANK OF COMMUNIC ATIONS	3,262,450	3,305,938.4 6	3.13

注：1. 债券代码为ISIN码；

2. 数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

### 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 10 投资组合报告附注

10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,472,218.21
5	应收申购款	15,461.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,487,679.34

#### 10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 五、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2020 年 6 月 30 日）

#### 1、华安美元票息债-A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2020年1月1日至 2020年6月30日	1.20%	0.44%	7.32%	0.41%	-6.12%	0.03%
2019年1月1日至 2019年12月31日	8.44%	0.18%	9.98%	0.28%	-1.54%	-0.10%
2018年1月1日至 2018年12月31日	0.19%	0.26%	4.81%	0.30%	-4.62%	-0.04%
2017年1月1日至 2017年12月31日	0.56%	0.22%	-2.33%	0.25%	2.89%	-0.03%
自基金合同生效 (2016年6月3日) 起至2016年12月 31日	7.00%	0.25%	4.44%	0.32%	2.56%	-0.07%

#### 2、华安美元票息债-C:

阶段	份额净	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	-----	-------	------	-------	-----	-----

	值增长 率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
2020年1月1日至 2020年6月30日	1.05%	0.43%	7.32%	0.41%	-6.27%	0.02%
2019年1月1日至 2019年12月31日	8.00%	0.18%	9.98%	0.28%	-1.98%	-0.10%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-0.37%	0.27%	4.81%	0.30%	-5.18%	-0.03%
2017年1月1日至 2017年12月31日	0.00%	0.22%	-2.33%	0.25%	2.33%	-0.03%
自基金合同生效 (2016年6月3日) 起至2016年12月 31日	6.70%	0.25%	4.44%	0.32%	2.26%	-0.07%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 六、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998 年 6 月 4 日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：021-38969999
- 11、客户服务电话：4008850099
- 12、联系人：王艳
- 13、网址：www.huaan.com.cn

### (二) 注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5 亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

### (三) 主要人员情况



## 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

### (1) 董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

吴从宏先生，大学学历，公共管理硕士学位。历任上海市国有资产监督管理委员会办公室主任科员、信访办副主任、主任等。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁，上海锦江资本股份有限公司执行董事、首席执行官，上海锦江国际投资管理有限公司董事长，Radisson Hospitality AB 董事长，华安基金管理有限公司董事，长江养老保险股份有限公司董事，史带财产保险股份有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主任、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、战略投资及直投业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略发展部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部

经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

**独立董事：**

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

朱宁先生，博士研究生学历，教授。2003年至2010年在美国加州大学（戴维斯分校）担任助理教授、终身教授，主要从事经济金融教学研究等工作；2010年至今在上海交通大学上海高级金融学院担任副院长、金融学教授，主要从事经济金融教学研究等工作。

**（2）监事会**

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

**（3）高级管理人员**

朱学华先生，本科学历，21年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生，21 年金融、基金行业从业经验。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

翁启森先生，硕士研究生学历，26 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

杨牧云先生，本科学历、硕士，20 年金融法律监管工作经验。历任上海市人民检察院科员，上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

姚国平先生，硕士研究生学历，16 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，21 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

范伟隽先生，硕士研究生学历，20 年金融、基金行业从业经验。历任毕马威华振会计师事务所项目经理，中国证监会上海监管局主任科员、副处长，富国基金管理有限公司督察长，华安基金管理有限公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司首席信息官。

## 2、本基金基金经理

庄宇飞先生，硕士研究生，9 年证券、基金从业经历，持有基金从业资格证书。历任上海证券创新发展总部分析师，上海吉金资产管理有限公司金融顾问事业部项目经理，上海证券创新发展总部创新实验室负责人。2016 年 6 月加入华安基金，任全球投资部基金经理助理。2017 年 3 月起担任华安全球美元收益债

券型证券投资基金、华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2018年6月起，同时担任华安全球稳健配置证券投资基金的基金经理。2020年4月起，同时担任华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理。

历任基金经理：

苏圻涵先生，2016年6月3日-2018年2月26日担任华安全球美元票息债券型证券投资基金基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，国际投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

张霄岭先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至2020年12月31日，公司目前共有员工382人（不含子公司），其中60.7%具有硕士及以上学历，94.8%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

（四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生；

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，不按照规定履行职责；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （8）其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

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

#### 5、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持

有人谋取最大利益；

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

(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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

###### (1) 健全性原则

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

###### (2) 有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

###### (3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

###### (4) 相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

###### (5) 成本效益原则

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

##### 2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

(1) 董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

(2) 监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和

公司管理层的行为行使监督权。

(3) 督察长：督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。

(4) 合规与风险管理委员会：合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

(5) 合规监察稽核部：合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，对督察长负责。

(6) 各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

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，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、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、岗位责任、操作守则等的具体说明。

### 4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### (1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括公司治理结构体系和内部控制体系。

公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来,通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识,致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设,建立了公司内部控制体系。

## (2) 风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查,发现风险,将风险进行分类、按重要性排序,找出风险分布点,分析其发生的可能性及对目标的影响程度,评估目前的控制程度和风险高低,找出引致风险产生的原因,采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后,确定应进一步采取的对应措施,对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善,并监督各个环节的改进实施。

## (3) 控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中,也得到了一贯的实施。主要包括:组织结构控制、操作控制、会计控制。

### ① 组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工,及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工,各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统,形成权责分明、严格有效的三道监控防线:

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线:各部门内部工作岗位合理分工、职责明确,对不相容的职务、岗位分离设置,使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系,以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线:公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度,后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。



## ② 操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、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，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

## ③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；会计账务的组织和处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

## (4) 信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司各级管理人员和员工可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

## (5) 内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查。检验其是否符合设计要求，并及时地充实和完善，反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势，确保内控制度的有效性。

#### 5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，经中国证监会 2016 年 1 月 21 日证监许可【2016】149 号文核准募集。

本基金自 2016 年 5 月 16 日起向全社会公开募集，截至 2016 年 5 月 30 日止募集工作顺利结束。

本基金为债券型证券投资基金。运作方式为契约型开放式，存续期限不定期。

本基金发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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（以人民币、美元）购买证券投资基金的其他投资人。

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 1,478,706,401.82 人民币，折合基金份额 1,478,706,401.82 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 239,360.95 元人民币，折合基金份额 239,360.95 份。本次募集所有资金已于 2016 年 6 月 2 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。本次募集有效认购户数为 401 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 1,478,945,762.77 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。按照有关法律规定，本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

## 八、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2016 年 6 月 3 日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 九、基金份额的申购、赎回

本基金同时设立人民币份额和美元份额。人民币份额以人民币计价并进行申购、赎回；美元份额以美元计价并进行申购、赎回。基金管理人可以在不违反法律法规及基金合同规定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，设立以其它币种计价的基金份额以及接受其它币种的申购、赎回。以其他外币种类进行基金份额申赎的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。销售机构的具体信息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，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

本基金不同类别份额的申购、赎回的销售机构可能不同，具体详见招募说明书。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资场所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的规定或本基金基金合同的约定暂停申购、赎回的除外。

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、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日对应份额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、本基金份额分为多个类别，适用不同的申购费率或销售服务费率，各类别基金份额可采用多币种销售；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

6、“分币种申购、赎回”原则，即以人民币申购获得人民币份额，赎回人民币份额获得人民币，以美元申购获得美元份额，赎回美元份额获得美元，其他外币份额依此类推；

7、投资者办理申购、赎回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。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人 T 日赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇外管局相关规定有变更、本基金所投资市场或外汇市场暂停交易或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项的支付时间可相应调整。在发生巨额赎回或本基金基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+3 日后(包括该日)及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

## 五、申购和赎回的数额限制

1、投资者通过非基金管理人以外的销售机构或基金管理人的电子交易系统首次申购人民币份额的单笔最低限额为人民币 1 元(含申购费，下同)，追加申购的单笔最低限额为人民币 1 元；投资者通过非基金管理人以外的销售机构首次申购美元现汇份额的单笔最低限额为 1 美元，追加申购的单笔最低限额为 1 美元；投资者通过基金管理人的直销机构首次申购人民币份额的单笔最低限额为人民币 100,000 元；追加申购的单笔最低限额为 100,000 元；直销机构不开通投资者外币申购业务以及美元现汇、美元现钞申购业务。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资人当期分配的基

金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回基金份额的单笔赎回申请不得低于 1 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 1 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3、本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 1 份。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

5、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，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

6、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费率

##### （1）A 类基金份额

对于 A 类基金份额，投资者在申购时需交纳前端申购费，其中人民币份额的申购费用以人民币支付，美元份额的申购费用以美元支付。本基金将对人民币份额和美元份额分别设置申购费率及金额分档标准。申购费率随申购金额的增加而递减。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。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

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

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类人民币基金份额的养老金客户



申购费率为每笔 500 元。

除上述养老金客户外,其他投资人申购本基金 A 类人民币基金份额申购费率如下所示:

申购金额 M (元)	申购费率
M<100 万	0.80%
100 万≤M<300 万	0.50%
300 万≤M<500 万	0.30%
M≥500 万	每笔 1000 元

本基金 A 类美元基金份额申购费率如下所示:

申购金额 M (美元)	申购费率
M<20 万	0.80%
20 万≤M<60 万	0.50%
60 万≤M<100 万	0.30%
M≥100 万	每笔 200 美元

(2) C 类基金份额

本基金 C 类基金份额目前只有人民币份额,不收取申购费用。

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

2、赎回费率

(1) A 类基金份额

本基金 A 类基金份额赎回费率按持有期递减,具体费率如下:

持有期限 (Y)	赎回费率
Y<7 天	1.50%
7 天≤Y<1 年	1.00%
1 年≤Y<2 年	0.50%
Y≥2 年	0

注:一年指 365 天,两年为 730 天

(2) C 类基金份额

本基金 C 类基金份额赎回费率按持有期递减,具体费率如下:

持有时间(Y)	赎回费率
$Y < 7$ 天	1.50%
$7 \leq Y < 30$ 天	0.50%
$Y \geq 30$ 天	0

(3) 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费用在投资人赎回基金份额时收取。本基金 A 类基金份额的赎回费用由赎回申请人承担，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其中，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回申请人承担，全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率，并进行公告。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

(1) 当投资者选择申购 A 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

本基金 A 类基金份额申购采用分币种金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

#### ①人民币申购份额的计算

人民币申购份额的计算方法为：

申购费用 = 申购金额 × A 类人民币基金份额申购费率 / (1 + A 类人民币基金份额申购费率)

(对于适用固定金额申购费的申购，申购费用 = 固定申购费金额)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类人民币基金份额净值

#### ②美元申购份额的计算

美元申购份额的计算方法为：

申购费用 = 申购金额 × A 类美元基金份额申购费率 / (1 + A 类美元基金份额申购费率)

(对于适用固定金额申购费的申购, 申购费用 = 固定申购费金额)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类美元基金份额净值

T 日 A 类美元基金份额净值 = T 日 A 类人民币基金份额净值 / T 日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价, 美元份额的基金份额净值的计算精确到 0.0001 美元, 小数点后第五位四舍五入, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。净申购金额、申购份额的计算结果按照四舍五入方法, 保留小数点后 2 位, 由此产生的误差计入基金资产。

(2) 当投资者选择申购 C 类基金份额时, 申购份额的计算方法如下:

申购份额 = 申购金额 / T 日 C 类基金份额净值

计算结果按照四舍五入方法, 保留小数点后 2 位, 由此产生的误差计入基金资产。

例 4: 某投资人 (非养老金客户) 投资 10 万元申购 A 类人民币基金份额, 对应费率为 0.80%, 假设申购当日 A 类人民币基金份额净值为 1.015 元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用 =  $100,000 \times 0.80\% / (1 + 0.80\%) = 793.65$  元

净申购金额 =  $100,000 - 793.65 = 99,206.35$  元

申购份额 =  $99,206.35 / 1.015 = 97,740.25$  份

即投资人 (非养老金客户) 投资 10 万元申购 A 类人民币基金份额, 假设申购当日 A 类人民币基金份额净值为 1.015 元, 则可得到 97,740.25 份 A 类人民币基金份额。

例 5: 某投资人 (非养老金客户) 投资 30 万美元申购 A 类美元基金份额, 对应费率为 0.50%, 假设申购当日 A 类美元基金份额净值为 0.2150 美元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用 =  $300,000 \times 0.50\% / (1 + 0.50\%) = 1,492.54$  美元

净申购金额 =  $300,000 - 1,492.54 = 298,507.46$  美元

申购份额 =  $298,507.46 / 0.2150 = 1,388,406.79$  份

即投资人 (非养老金客户) 投资 30 万美元申购 A 类美元基金份额, 假设申

购当日 A 类美元基金份额净值为 0.2150 美元, 则可得到 1,388,406.79 份 A 类美元基金份额。

例 6: 某投资人(非养老金客户)投资 10 万元申购 C 类基金份额, 对应费率为 0.80%, 假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.015 = 98,522.17 \text{ 份}$$

即投资人(非养老金客户)投资 10 万元申购 C 类基金份额, 假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元, 则可得到 98,522.17 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

本基金赎回采用份额赎回的方式, 赎回金额以当日该类基金份额净值为基准计算, 计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后 2 位。

(1) 当投资者赎回 A 类基金份额时, 赎回金额的计算方法如下:

### ①人民币赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为:

$$\text{赎回总额} = \text{赎回 A 类人民币基金份额} \times \text{赎回当日 A 类人民币基金份额净值}$$

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

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

### ②美元赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为:

$$\text{赎回总额} = \text{赎回 A 类美元基金份额} \times \text{赎回当日 A 类美元基金份额净值}$$

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

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

(2) 当投资者赎回 C 类基金份额时, 赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回金额} = \text{赎回 C 类基金份额} \times \text{赎回当日 C 类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

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

例 7: 某投资人持有 10 万份 A 类人民币基金份额, 持有六个月后赎回, 赎回费率为 1.00%, 假设赎回当日 A 类人民币基金份额净值是 1.015 元, 则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.015 = 101,500.00 \text{ 元}$$

赎回费用=101,500.00×1.00%=1,015.00 元

赎回金额=101,500.00-1,015.00=100,485.00 元

即投资人持有 10 万份 A 类人民币基金份额，持有六个月后赎回，假设赎回当日 A 类人民币基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,485.00 元。

例 8：某投资人持有 10 万份 A 类美元基金份额，持有一年六个月后赎回，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类美元基金份额净值是 0.2150 美元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×0.2150=21,500.00 美元

赎回费用=21,500.00×0.50%=107.50 美元

赎回金额=21,500.00-107.50=21,392.50 美元

即投资人持有 10 万份 A 类美元基金份额，持有一年六个月后赎回，假设赎回当日 A 类美元基金份额净值是 0.2150 美元，则其可得到的赎回金额为 21,392.50 美元。

例 9：某投资人持有 10 万份 C 类基金份额，持有 15 天后赎回，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.015=101,500.00 元

赎回费用=101,500.00×0.50%=507.50 元

赎回金额=101,500.00-507.50=100,992.50 元

即投资人持有 10 万份 C 类基金份额，持有 15 天后赎回，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

### 3、基金份额净值的计算

本基金各类别基金份额 T 日的基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。人民币份额的基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数，人民币份额的基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担；美元份额的基金份额净值为计算日人民币基金份额净值按中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算的美元金额，美元份额的基金份额净值的计算精确到 0.0001 美元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。遇特殊情况，根据基金合同约定或经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

未来，若市场情况发生变化，或实际情况需要，经中国证监会允许，本基金可相应调整基金净值计算和公告时间或频率并提前至少 10 个工作日公告。

#### 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某一类币种份额或多类币种份额的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
- 3、基金投资的主要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、基金投资所处的主要市场或外汇市场休市时；
- 5、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；
- 6、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 7、基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限，或基金管理人管理的境外证券投资基金的资产规模达到外管局核定的本基金管理人境外证券投资额度（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）；
- 8、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 9、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 10、基金销售机构或登记机构的技术保障等发生异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- 11、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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 12、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- 13、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、5、6、7、9、10、11、13 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，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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对某一类币种份额或多类币种份额的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
- 3、本基金投资的主要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、基金投资所处的主要市场或外汇市场休市时；
- 5、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；
- 6、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- 7、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时，可暂停接受投资人的赎回申请；
- 8、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的，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。在计算单个赎回申请人的赎回申请量所代表的基金资产净值和赎回申请总量所代表的基金资产净值时，美元份额所代表的部分依据当日适用的汇率折算为人民币。若出现上述第 6 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时

恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的该币种基金份额的赎回申请有困难或认为因支付投资人的该币种基金份额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该币种基金份额的赎回比例不低于上一开放日该币种基金总份额的 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，应当按单个基金份额持有人申请赎回该币种基金份额数占当日该类币种基金份额赎回申请总份额数的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的该币种基金份额的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该币种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。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。

(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，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个估值日各类基金份额的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

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

## 十三、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，或按法律法规或有权机关规定的方式处理。

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

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

#### 十五、定期定额投资计划

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

#### 十六、基金份额的冻结和解冻

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

#### 十七、基金份额的转让

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

## 十、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（含境外托管人收取的费用）；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用）；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、基金收益分配过程中发生的费用；
- 10、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 11、基金的资金汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；
- 13、为保障基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用；
- 14、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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### 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0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。

上述除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或

基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒介上刊登公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

## 十一、基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人签订的次托管协议为本基金在境外开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金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，并由基金托管人和/或其委托的境外托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

基金份额持有人、基金管理人和基金托管人理解现金于存入托管账户时即构成基金托管人、境外托管人的等额债务，该等现金归入其清算财产并不视为基金

托管人违反本合同的规定，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不得归于其清算财产。

境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券、期货交易所规则、市场惯例及其与基金托管人签订的主次托管协议并保管基金财产。除非基金管理人、基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金管理人、基金托管人不对境外托管人依据当地法律法规、证券、期货交易所规则、市场惯例的作为或不作为承担责任。

本基金如果投资境外非上市证券，基金管理人应与基金托管人就有关非上市证券托管等相关事宜在本基金托管协议中明确约定。

## 十二、基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日，T+1日完成T日估值，T+2日内披露。

### 二、估值对象

本基金所拥有的各类有价证券及本基金依据相关法律法规持有的其它资产。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

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

#### 2、处于未上市期间的权益类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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

#### 3、债券估值方法：

（1）对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含



的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值；

(2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值；若债券价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

#### 4、衍生品估值方法：

(1) 上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(2) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值；若衍生品价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

#### 5、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

#### 6、基金估值方法：

(1) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(2) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 若基金价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

#### 7、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### 8、估值中的汇率选取原则：

(1) 人民币对主要外汇的汇率应当以中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价为准；

(2) 其他货币与人民币的汇率则以估值日伦敦时间下午四点（或能够取到的离下午四点最近时点）由彭博信息(Bloomberg)提供的其他币种与美元的中间价套算。

若无法取得上述汇率价格信息时，以本基金托管银行中国建设银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

#### 9、估值中的税收处理原则：

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可以聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

10、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-9 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第 1-7 项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

11、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

12、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。

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

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

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

#### 四、估值程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 五、估值错误的处理

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

本基金基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

(2) 基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5%时,基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整,不做追溯处理;当错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当通报基金托管人、公告并报中国证监会备案。

(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、基金投资所涉及的相关交易市场、外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于保障基金份额持有人利益；
- 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- 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，基金管理人应当暂停估值；
- 6、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

本基金分别计算并披露不同类别份额对应的基金份额净值。人民币份额的基金份额净值的计算分别精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入；美元份额的基金份额净值的计算分别精确到 0.0001 美元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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估值日计算前一工作日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按基金净值按规定予以公布。

#### 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

3、全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在本基金管理人和本基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

4、由于不可抗力原因，或由于相关交易所、外汇市场及登记结算公司、数据服务机构发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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减轻或消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、汇兑损益、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

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

1、在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，各类基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对某一类别基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则某一币种的份额相应的以该币种进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

3、基金收益分配基准日人民币份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值；对于外币份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后外币份额基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；

4、由于本基金各类基金份额分别以其认购或申购时的币种计价，每类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别/币种的每份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

#### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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。基金收益分配方案确定后，由基金管理人按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

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



## 十四、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度，并在法律法规允许的范围内参考国际会计准则；
- 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托管协议约定方式确认。

### 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、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十五、基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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、法人和非法人组织的祝贺性、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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字。

本基金的人民币份额以人民币计算并披露净值及相关信息；美元份额以美元计算并披露净值及相关信息。本基金除特别说明外，人民币份额的货币单位为人民币元，美元份额的货币单位为美元。

在未来法律法规允许的情况下，本基金可以人民币和美元以外的币种计算并披露净值及相关信息。涉及币种之间转换的，应当披露汇率数据来源，并保持一致性。如果出现改变，应当予以披露并说明改变的理由。人民币对主要外汇的汇率应当以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

## 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、基金产品资料概要

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品

资料概要。

## （二）基金份额发售公告

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

## （三）《基金合同》生效公告

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

## （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的2个工作日内，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的2个工作日内，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## （五）基金份额申购、赎回价格

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

## （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中

期报告或者年度报告。

本基金若投资境外衍生品，基金管理人应在会计年度结束后 60 个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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、中期报告、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，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、

基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、基金收益分配事项；

15、基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值估值错误达某一类别基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、本基金变更份额类别设置；

22、开通多币种申购、赎回业务；

23、选择或更换境外投资顾问、境外托管人；

24、基金推出新业务或服务；

25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

26、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会和基金合同规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十）清算报告

基金合同出现终止情形的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（十一）本基金若投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期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。

（十二）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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基

金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

1、基金投资所涉及的相关交易所、外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、不可抗力；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于保障基金份额持有人利益；

4、出现会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

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一致暂停估值的；

6、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

对于因不可抗力等原因导致基金信息的暂停或延迟披露的（如暂停披露基金净值信息），基金管理人应及时向中国证监会报告，并与基金托管人协商采取补救措施。不可抗力情形消失后，基金管理人和基金托管人应及时恢复办理信息披露。

九、法律法规或中国证监会对信息披露另有规定的，从其规定。



## 十六、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。对于法律法规规定或基金合同约定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须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### 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、基金份额持有人数量连续 60 个工作日少于 200 人或基金资产净值（美元份额所对应的基金资产净值需按计算日汇率折算为人民币）连续 60 个工作日低于 5000 万元的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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剩余财产中支付。

#### 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。

#### 八、基金的合并

本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。

## 十七、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：周海新

联系电话：(021)6063 7111

#### （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户服务处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目

前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年及 2019 年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运

作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

## 十八、境外托管人

### （一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Ron O' Hanley

成立时间：1891 年 4 月 13 日

最近一个会计年度（截止到 2020 年 6 月 30 日）所有者权益（Shareholders' Equity）248.73 亿美元

### （二）托管资产规模、国际信用评级和托管业务

道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于 1891 年，自 1924 年成为美国第一个共同基金的托管人后，道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至 2020 年 6 月 30 日，托管和行政管理资产总额已达到 33.52 万亿美元，一级资本比率为 15.1 %。道富银行长期存款信用评级为 AA-（标准普尔）及 Aa1（穆迪投资）。道富银行在全球 30 多个国家或地区设有办事处，截至 2020 年 6 月 30 日道富拥有 3 万 9 千名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务，包括全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

### （三）境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、计算境外受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- 7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 十九、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）华安基金管理有限公司上海业务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层

电话：（021）38969973

传真：（021）58406138

联系人：姚佳岑

##### （2）华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 522 室

电话：（010）57635999

传真：（010）66214061

联系人：刘雯

##### （3）华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路 8 号高德置地夏广场 D 座 504 单元

电话：（020）38082891

传真：（020）38082079

联系人：林承壮

##### （4）华安基金管理有限公司西安分公司

地址：陕西省西安市高新区唐延路 35 号旺座现代城 H 座 2503

电话：029-87651812

传真：（029）87651820

联系人：赵安平

##### （5）华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段 19 号威斯顿联邦大厦 12 层 1211K-1212L

电话：（028）85268583

传真：（028）85268827

联系人：郁晓珍

##### （6）华安基金管理有限公司沈阳业务部



地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：杨贺

(7) 华安基金管理有限公司深圳业务部

地址：深圳福田区金田路 2030 号卓越世纪中心 3 号楼 2008 室

邮编：518000

电话：0755-82755911

联系人：唐硕

(8) 华安基金管理有限公司南京业务部

地址：江苏省南京市秦淮区中山南路 1 号 南京中心 1915

电话：025-86890489

联系人：黄雷

(9) 华安基金管理有限公司华东业务部

地址：福建福州鼓楼区五四路 151 号宏远帝豪国际大厦 2307 室

电话：0591-87831775

联系人：王枫

(10) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

## 2、代销机构

(1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客户服务电话：95559

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

(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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(3) 平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

办公地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511

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

(4) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

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

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

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

(6) 中国银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 1 号

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

代销人民币份额 A 类（002426）：

（1）中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行大厦 1585 室

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行大厦 8 层

法定代表人：许欣

客户服务电话：400-700-9700(长途免费)—钱滚滚专线

公司网址：[www.qiangungun.com](http://www.qiangungun.com)、手机“钱滚滚”APP 或钱滚滚官方微信

（2）财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201 室,501 室,502 室,1103 室,1601-1615 室,1701-1716 室

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：陆建强

客服电话：95336

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

同时代销人民币份额 A 类（002426）与 C 类（002429）的代销机构如下：

（1）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼

法定代表人：杨华辉

客户服务电话：95562

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

（2）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

客户服务电话：400-866-6618

网址：[www.lu.com](http://www.lu.com)

（3）上海长量基金销售有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.e-rich.com.cn

(4) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

网址：www.yilucaifu.com

(5) 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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场

法定代表人：李兴春

客户服务电话：4000676266

网址：www.leadfund.com.cn

(6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(7) 上海联泰资产管理有限公司

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 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

客户服务电话：400-046-6788

网址：www.66zichan.com

(8) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼

法定代表人：其实

电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(9) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：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

客服电话：021-96250500

网址：www.swhysc.com

(10) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：王连志

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

(11) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553、4008888001

网址：www.htsec.com

(12) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918

网址：www.shzq.com

(13) 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客户服务电话：95318

网址：www.hazq.com

(14) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(15) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(16) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 层

法定代表人：张建军

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

(17) 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

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(18) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人: 杨德红

客户服务电话: 95521

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

(19) 长城证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

法定代表人: 丁益

客户服务电话: 400-6666-888

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

(20) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 张志刚

客户服务电话: 95321

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

(21) 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

办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人: 叶顺德

客户服务电话: 95399

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

(22) 联讯证券股份有限公司

注册地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

西

面一层大堂和三、四层

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西

面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

客服电话：0752-95564

网址：<http://www.lxsec.com>

(23) 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

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(24) 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

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26 层、27 层及

28

层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：(010) 65051166

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

(25) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

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

(26) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号



法定代表人：尤习贵

客户服务电话：95579

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

（27）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

客户服务电话：028-86712334

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

（28）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

客户服务电话：95531

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

（29）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

办公地址：云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

法定代表人：李长伟

客服电话：95397

网址：<http://www.tpyzq.com>

（30）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

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东楼2层

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

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

（31）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

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：0755-23835888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(32) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

客户服务电话：95525、4008888788

网站：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(33) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：95551/4008-888-888

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

(34) 宏信证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

办公地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008-366-366

网址：<http://www.hxzq.cn>

(35) 华龙证券股份有限公司

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

办公地址：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：李晓安

客户服务电话：0931-4890619

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

(36) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

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

(37) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人：刘惠

客户服务电话：400-808-1016

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

(38) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：4000-766-123

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

(39) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

电话：4006788887

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

(40) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：马勇

客户服务电话：4001161188

网址：<https://8.jrj.com/>

(41) 北京虹点基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

(42) 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：上海杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋2楼

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(43) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道1号宝利国际广场南塔12楼

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

(44) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼

法定代表人：李秀仑

客户服务电话：(021) 962999

网址：www.srcb.com

(45) 泰信财富投资管理有限公司

地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

法定代表人：李静

客户服务电话：400-168-7575

网址：www.taixincf.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

法定代表人：陈继武

客户服务电话：4000 178 000

网址：www.lingxianfund.com

（47）上海中正达广基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客户服务电话：400-6767-523

网址：www.zzwealth.cn

（48）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客户服务电话：（021）95594

网址：www.bankofshanghai.com

（49）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：易峥

客户服务电话：4008-773-772 0571-88920897

网址：www.5ifund.com

（50）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（51）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（52）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

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

客户服务热线：95565

网站：www.newone.com.cn

（53）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：李伏安

客户服务电话：400-888-8811

网址：www.cbhb.com.cn

（54）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：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：4000618518

网站：<https://danjuanapp.com/>

（55）奕丰基金销售有限公司

地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻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：TAN YIK KUAN

客户服务电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

（56）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

办公地址：北京市海淀区海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层

法定代表人：张琪

联系电话：010-62675369

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

（57）嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

办公地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：夏林生

联系电话：0573-96528

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

（58）宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

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

（59）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

客户服务电话：400-821-0203

（60）南京途牛金融信息服务有限公司

地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

客服电话：4007-999-999

网址：<http://jr.tuniu.com>

（61）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

办公地址：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

客户服务电话：0591-96326

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

(62) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：高利

客户服务电话：0731-95571

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

(63) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人：刘世安

客户服务电话：95511-8

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

(64) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 6 层

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 6 层

法定代表人：李淑慧

联系电话：0371-85518396

传真号码：0371-85518397

(65) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓晖

客服电话：95528

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

(66) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层



法定代表人：戴新装

客服电话：4008201515

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

（67）乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人：王兴吉

客服电话：4000888080

网站：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

（68）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

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：冯鹤年

客户服务电话：4006198888

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

（69）北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址：北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号

法定代表人：许现良

联系电话：4001-500-882

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

（70）东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人：陈太康

电话：95531/400-8888588

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

（71）河北银行股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市平安北大街28号

办公地址：河北省石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

客户服务电话：400-612-9999

公司网站：www.hebbank.com

(72) 济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 财富中心 A 座 46 层济安财富

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）

公司网站：www.jianfortune.com

(73) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

(74) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816

公司网址：http://fund.jd.com/

(75) 福建海峡银行股份有限公司

注册地址：福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行

办公地址：福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行

法定代表人：俞敏

客户服务热线：400-893-9999

公司网站：www.fjhxbank.com

(76) 上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海浦东碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系电话：021-80234888

网址：<http://www.go-goal.com>

(77) 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：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

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

(78) 上海通华财富基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 层

法定代表人：马刚

客户服务电话：95156

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

(79) 珠海华润银行股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号

办公地址：广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号

法定代表人：刘晓勇

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

客户服务电话：96588

(80) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客户服务电话：4008308003

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

(81) 晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

法定代表人：上官永清

客服电话：95105588

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

(82) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 幢  
23 层

1 号、4 号

法定代表人：陶捷

客户服务电话：400-027-9899

网 址：<http://www.buyfunds.cn/>

(83) 中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

法定代表人：弭洪军

全国统一客服电话：400-876-5716

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

(84) 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

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(85) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋  
3

单元11层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋

3

单元 7 层

法定代表人：赖任军

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：www.jfzinv.com

(86) 上海基煜基金销售有限公司

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

法定代表人：王翔

公司网站：www.jiyufund.com.cn/

客户服务电话：400-820-5369

(87) 深圳市锦安基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管  
理  
局综合办公室 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：李学东

联系电话：400-071-9888

网址：http://tz.glodann.com.cn/

(88) 中信期货有限公司

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

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(89) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系电话：（0519）96005

网址：<http://www.jnbank.com.cn/index.html>

(90) 万家财富基金销售(天津)有限公司

住所：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

法定代表人：李修辞

客户服务电话：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

(91) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809

法定代表人：戎兵

网址：<http://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

(92) 深圳信诚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海

商务秘书有限公司）

法定代表人：周文

客服：400-666-0066

网站：[www.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com)

(93) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：彭运年

客户服务电话：4008909998

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

(94) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客户服务电话：4008-588-588

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

(95) 四川天府银行股份有限公司

住所：四川省南充市涪江路1号

法定代表人：黄光伟

热线电话：400-16-96869 028-96869

网址：<http://www.cgnb.cn/pub/ncsh/>

(96) 成都华羿恒信财富投资管理有限公司

注册地址：成都市高新区天府大道中段199号棕榈国际中心1幢1单元19层

4号

办公地址：成都市高新区天府大道中段199号棕榈国际中心1幢1单元19层

4号

法定代表人：赵壁

电话：400-8010-009 028-87326832

网址：<http://www.huayihengxin.com/>

(97) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层-43层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层-43层

客服电话：400-889-5618

网址：<http://e5618.com>

法人代表：姜志军

(98) 包商银行股份有限公司

地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

客服电话：95352

网站：<http://www.bsb.com.cn/>

(99) 大河财富基金销售有限公司

住所：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

网址：<http://www.urainf.com/>

联系电话：0851-88235678

(100) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

电话：400-100-3391

网址：<http://www.dianyingfund.com/>

(101) 上海有鱼基金销售有限公司

办公地址：上海徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

客服电话：021-60907378

网址：<http://www.youyufund.com/>

(102) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

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

(103) 洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

法定代表人：任淑桢

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室

办公地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 706 室；北京市西什库

大街 31 号九思文创园

客服电话：400 6706 863

网址：<https://www.hongtaiwealth.com>



(104) 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 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

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

法定代表人：陈洪生

客服热线：400-918-0808

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

(105) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

(106) 上海钜派钰茂基金销售公司

注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼

法定代表人：胡天翔

联系电话：021-50778395

(107) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二

期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4000218850

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

(108) 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 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：021-50810673

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

(109) 苏州银行股份有限公司

注册地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人: 王兰凤

客服电话: 96067

网站: [www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

(110) 北京百度百盈基金销售有限公司

地址: 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦 1 层

法定代表人: 张旭阳

客户服务中心电话: 95055-4

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

(111) 浦领基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人: 李招弟

电话: 400-876-9988

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

(112) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人: 王伟刚

客户服务电话: 400-619-9059

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

其他基金份额发售机构详见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据实际情况增加或减少销售代理机构,并在基金管理人网站公示。

3、其他基金份额发售机构详见基金份额发售公告。

(二) 登记机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号二期 31—32 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号二期 31—32 层

法定代表人：朱学华

电话：(021) 38969999

传真：(021) 33627962

联系人：赵良

(三)、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

(四)、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

首席合伙人：毛鞍宁

电话：(021)2228 8888

传真：(021)2228 0000

联系人：陈胜

经办律师：陈胜、张旭颖

## 二十、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 二十二、对基金投资人的服务

本公司承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,适时对服务项目进行调整。主要服务内容如下:

### (一) 投资人对账单服务

本公司在每个自然年度结束后 20 个工作日内向定制纸质对账单的基金份额持有人寄送纸质对账单;每月向定制电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。

### (二) 客户服务中心电话服务

客户服务中心提供 7X24 小时的基金净值信息、投资人账户交易情况、基金产品与服务等信息的自助查询。

客户服务中心人工座席在交易日提供人工服务,基金投资人可以通过客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、账户资料修改等专项服务。

### (三) 网络在线服务

投资人可以通过本公司网站的“在线客服”在线就基金投资、交易操作中的各种问题进行咨询互动或留言。

### (四) 信息定制服务

投资人可以通过拨打本公司客服热线、发送邮件或者直接登录本公司网站定制电子对账单及资讯服务等各类信息服务。

### (五) 投诉受理服务

投资人可以通过各销售机构网点柜台、客服热线人工服务、在线客服、客服电子邮箱、纸质信函等多种不同的渠道提出投诉或意见。本公司对于工作日期间受理的投诉,原则上在受理投诉后 2 个工作日内回复;对于非工作日提出的投诉,将在顺延的 2 个工作日内进行回复。

### (六) 网站交易服务

依据相关的招募说明书、基金合同的约定以及《业务规则》的规定,本公司可向个人投资人和机构投资者提供基金电子直销交易服务。具体业务规则详见基金管理人网站说明。

### (七) 基金管理人客户服务联系方式

客户服务中心热线：40088-50099（免长途话费）

客户服务传真：（021）33626962

公司网址：www.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

客服地址：上海市四平路 1398 号 同济联合广场 B 座 14 楼

邮政编码：200092

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务中心热线，或通过电子邮件、传真、信件等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。

## 二十三、其他应披露事项

1. 近三年基金管理人及其高级管理人员没有受到过中国证监会及工商、财税等有关机关的处罚。

### 2. 本期公告事项

序号	公告事项	信息披露媒介名称	披露日期
1	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
2	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金暂停大额申购、大额定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-23
3	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金暂停申购、定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
4	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
5	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
6	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-11
7	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
8	华安基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司	《证券日报》、中国证监会基金电子披	2020-04-24



	办理旗下基金相关销售业务的公告	露网站和公司网站	
9	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
10	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金恢复申购及限制大额申购、大额定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-05
11	关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-16
12	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
13	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
14	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30
15	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-07-21
16	关于旗下基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-08
17	华安基金关于旗下基金参加渤海银行优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-15
18	华安基金管理有限公司关于总经理	《证券日报》、中国	2020-08-15

	变更的公告	证监会基金电子披露网站和公司网站	
19	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-22
20	华安基金管理有限公司关于暂停深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-25
21	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-28
22	华安全球美元票息债券型证券投资基金（华安美元票息债-A）基金产品资料概要-002427 美元份额	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-31
23	华安全球美元票息债券型证券投资基金（华安美元票息债-A）基金产品资料概要	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-31
24	华安全球美元票息债券型证券投资基金（华安美元票息债-C）基金产品资料概要	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-31
25	华安基金管理有限公司关于暂停深圳市锦安基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-04
26	华安基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-08
27	华安基金管理有限公司关于暂停上海有鱼基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-11

28	华安基金管理有限公司关于包商银行股份有限公司转让相关业务的提示性公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-17
29	关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-24
30	关于暂停中民财富基金销售(上海)有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-24
31	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
32	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
33	关于旗下基金参加嘉兴银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-29
34	关于暂停前海凯恩斯基金销售有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-30
35	关于旗下基金参加中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-09
36	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-17
37	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司	2020-10-27

		网站	
38	华安基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-28
39	关于旗下部分基金参加上海证券有限责任公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-12
40	关于旗下基金参加宁波银行费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-26
41	华安基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司等三家销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-15
42	华安基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-18
43	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-18
44	华安基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-23
45	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
46	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28

47	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-30
48	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-13
49	华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-21
50	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金恢复大额申购及大额定期定额投资业务的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-22
51	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-02-06

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

## 二十五、备查文件

### 一、备查文件

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

二、存放地点：除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

三、查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇二一年三月五日

## 附件一：基金合同内容摘要

第一部分基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 一、基金份额持有人

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) 依法转让或者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或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；



(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金管理人

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、

赎回、转换、转托管、非交易过户、定期定额投资、收益分配、开通人民币、美元之外的其他币种的申购、赎回等方面的业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率、托管费率和销售服务费率之外的相关费率结构和收费方式；

(17) 选择、更换或撤销境外投资顾问；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

(6) 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；

(7) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 依法接受基金托管人的监督；

(11) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定

基金份额申购、赎回的价格；

(12) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(13) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(18) 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；

(19) 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；

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

(21) 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；

(22) 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；

(23) 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；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 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；

(27) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(28) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(29) 建立并保存基金份额持有人名册；

(30) 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、基金托管人

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》的规定安全保管可以保管的基金财产；

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

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

(4) 选择、更换或撤销境外托管人；

(5) 根据相关市场规则，在基金托管人、境外托管人处为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

(6) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(7) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定在基金托管人、境外托管人处开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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) 基金托管人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(12) 第(11)项所述资料外，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；

(13) 建立并保存基金份额持有人名册；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

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

- (17) 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；
- (18) 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和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (20) 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；
- (21) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (22) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (23) 对基金的境外财产，基金托管人可以委托符合《试行办法》规定条件的境外托管人负责境外资产托管业务。境外托管人依据基金财产投资地法律法规、监管要求、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人之间的主次托管协议持有、保管基金财产，并履行资金清算等职责；
- (24) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；
- (25) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- (26) 境外托管人准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入；
- (27) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- (28) 法律法规、中国证监会、外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第二部分基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代

表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

#### 一、召开事由

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

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费

方式；

(4) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少或调整基金份额类别及定义，变更收费方式；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(7) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户、定期定额投资等业务规则，或增设其他外币种类的基金份额类别、或者调整现有基金销售币种设置、或者停止现有币种的销售等；

(8) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，本基金推出新业务或新服务；

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额



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

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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或大会公告载明的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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自表决通过之日起生效，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决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 第三部分基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### 一、《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、基金份额持有人数量连续 60 个工作日少于 200 人或基金资产净值（美元份额所对应的基金资产净值需按计算日汇率折算为人民币）连续 60 个工作日低于 5000 万元的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### 二、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托

管人、具有从事证券、期货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。

### 三、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剩余财产中支付。

### 四、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。

### 五、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。

### 六、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。

#### 第四部分争议解决方式

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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 第五部分基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。



## 附件二：托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

邮政编码：200120

法定代表人：朱学华

成立日期：1998 年 6 月 4 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资于境内境外市场。

针对境内投资，本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法上市的股票），权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具。

针对境外投资，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外融工具。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%；

2、本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

4、本基金境内投资的，还须遵循以下限制：

(a) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；本基金管理人管理的且由本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%；

(b) 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%；

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

(d) 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%；

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

(f) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(j) 基金财产参与境内股票发行申购，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；

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

(l) 本基金的其他境内投资限制根据相关法律法规及中国证监会规定和基金合同约定进行限制；

(m) 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；

5、本基金境外投资的，还须遵循以下限制：

(a) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中境外投资中，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

(b) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管

理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）；

（c）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

（d）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

（e）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制；

（f）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

（g）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准；

（h）本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。

#### 6、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。若基金超过上述除第 2、3 项以外的投资比例限制，针对境内投资部分，除上述第（i）、（m）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定，从其规定。针对境外投资部分，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合投资比例限制要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

#### （三）金融衍生品投资限制

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，投资于境外金融衍生品的，同时应当严格遵守下列规定：

1. 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2. 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3. 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

(2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

(3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4. 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

(四) 本基金可以根据正常市场惯例参与境外正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1. 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2. 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3. 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4. 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5. 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(五) 基金参与正回购交易，所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与正回购交易而持有的担保物、

现金不得计入基金总资产。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对本托管协议第十六条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行信息披露义务,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。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、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。

(八) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的合理疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金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。

(九) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、

行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

（十一）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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、基金管理人有关基金托管人的业务核查

（一）基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

（三）基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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可以保管的基金财产。
- 3.基金托管人按照规定在基金托管人、境外托管人处开设基金财产的资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5.基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，并按指令进行结算，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6.基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将托管证券及其收益归入其清算财产；基金管理人和基金托管人理解现金于存入现金账户时构成基金托管人、境外托管人的等额债务，除非法律法规及撤销或清盘程序明文许可该等现金不归于清算财产外，该等现金归入清算财产并不构成基金托管人违反托管协议的规定。
- 7、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。
- 2.基金募集期满或基金停止募集时，基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3.若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人

按规定办理退款等事宜。

（三）基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和供境内账户资金划拨使用。基金托管人可委托境外托管人开立资金账户（境外），境外托管人根据基金托管人的指令办理境外资金收付。

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

3.基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户的开立和管理

基金托管人委托境外托管人在境外，根据当地市场法律法规规定，开立和管理证券账户。

（五）其他账户的开立和管理

1.因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或其委托机构负责开立。

2. 投资所在国家或地区法律法规对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（六）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的境外有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人委托境外托管代理人存放于其保管库。基金托管人对由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。

（七）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托

管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供合同复印件,并在复印件上加盖公章,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

#### (八) 有关非上市证券托管

基金管理人与基金托管人签署的本托管协议或相关附件及/或补充协议中约定的服务,基金管理人可能经常要求基金托管人在接到基金管理人指令后,交割及/或持有以实物形式存在的非上市股权、债券,即未在公开投资交易所挂牌交易的股权、债券(以下合称“非上市证券”),包括登记在基金管理人名义下的证券,以前前登记的所有人名义持有的证券、或不受基金托管人及/或基金托管人指定的代理人(包括但不限于基金托管人指定的境外托管人,以下简称“代理人”)控制的人的名义或方式持有的证券。

特此确认,基金托管人及代理人此前已经并且今后将继续依据基金管理人就此类事项所发出的指令操作,前提是基金管理人特此确认如下内容:

(a) 此类事项将涉及特殊的服务、风险和潜在义务;

(b) 基金管理人同意,与基金管理人签订的本托管协议或相关附件及/或补充协议中包含的有关指令的免责条款适用于针对非上市证券作出的所有操作;且

(c) 基金托管人及代理人可能无法实施与非上市证券有关的部分特殊托管服务(包括但不限于定价、代理投票、公司行动、投资收益代收、申请退税等);并且基金托管人的唯一责任为:

(i) 按照经过正常授权的指令操作;

(ii) 如资产在不受基金托管人及代理人控制的第三方处保管,则将仅传递由该等第三方提供的证券信息;并且

(iii) 如资产将由基金托管人及代理人保管,则将使该等非上市证券与基金托管人及代理人的自有资产分开保管,并在接到基金管理人指令后归还该等非上市证券。

基金托管人已经做好准备,可继续就此事宜为基金管理人提供协助,但是,必须明确指出:对于因同意交割及/或持有非上市证券而导致的任何损失、义务、

成本、罚款、处罚、索赔和费用（以下统称“损失”），基金托管人对此不承担任何责任，但因基金托管人欺诈、故意违约或重大过失造成的除外。上述损失可能涉及以下方面，包括但不限于：与非上市证券的所有权有关的问题、账目差错、伪造股票证书、或在以不受基金托管人及代理人控制的人或第三方的名义登记的非上市证券交割和后续的托管过程中产生的任何一般性损失。

以下列出了基金托管人认为在上述非上市证券持有方式下，基金管理人可能遭受的损失。但是基金托管人认为有必要指出，在此并未列出所有风险，除此之外，可能还存在其他风险。

如非上市证券登记在基金管理人名下，或登记在不受基金托管人及代理人控制的人名下，或在不受基金托管人及代理人控制的第三方处保管，则基金托管人及代理人将仅负责按照基金管理人的恰当指令，（1）保管用于代表或声称代表该等非上市证券及相关权利的证书、文件或单据（“权利文书”）；以及（2）传递由上述第三方提供的证券信息，前提是基金托管人及代理人实际收到了来自第三方的证券信息。但是基金托管人及代理人不会以任何明示或暗示的方式对任何上述权利文书以及证券信息的真实性、有效性、准确性和完整性负责，也不会对其作出任何验证。基金管理人应当负责对上述权利文书和证券信息进行验证。如果上述第三方（包括但不限于非上市证券的发行人）直接向基金管理人传递证券信息，则基金管理人应对此等证券信息的传递和沟通负责。

如非上市证券由不受基金托管人及代理人控制的第三方（可能包括也可能不包括第三方托管人）通过其簿记账目、保函或其他保证的方式持有，基金托管人对于该等第三方的违约或欺诈不承担任何责任。

如后期基金管理人希望出售该等非上市证券，第三方可能会对出售非上市证券实施额外限制，从而会影响基金管理人实现这一目标。上述第三方所实施的任何限制均不受基金托管人及代理人的控制。对于不受基金托管人及代理人控制的第三方实施的任何限制，基金托管人不会以任何明示或暗示的方式承担任何责任。

基金托管人及代理人可能无法协助基金管理人代收非上市证券的收益。如由第三方负责代收非上市证券的收益，则基金托管人及代理人将仅负责在实际收到结算资金时，将该等收益贷记入相关账户中。此外，上述收益后期可能需要代扣所得税，在任何情况下，非本国居民可能需要纳税，如未纳税或未按时纳税，可

能会导致处罚或罚息。

如第三方无力偿还债务，基金管理人可能会丧失对于非上市证券的“所有权”（或可能需要根据当地法律法规的规定延期行使权利），而非上市证券则会被划入普通债权人可用的持有人所有的资产池中。

上述一项或全部各项相关的诉讼及/或其他行政管理费用，可能导致须由基金管理人承担的成本。

基金托管人可在此确认，就基金托管人作为上述非上市证券托管人的义务范围已与基金管理人达成一致；且基金管理人同意将按照本条款和托管协议或相关附件及/或补充协议中的约定赔偿基金托管人遭受的损失（包括但不限于合理的律师费，以及代理人等第三方向我方主张的损失、成本和费用等）并使基金免于损失。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。人民币份额的基金份额净值的计算分别精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入；美元份额的基金份额净值为计算日人民币基金份额净值按中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算的美元金额，美元份额的基金份额净值的计算精确到0.0001美元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2.基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对前一工作日基金资产估值后，将基金资产净值、基金份额净值发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保存期不少于20年，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。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。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

- 1.《基金合同》终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

### （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、期货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)将清算结果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。

#### 6.清算费用

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

#### 7.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。

#### 8.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的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。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 9.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。